

长信利保债券型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2016 年第【1】号

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

长信利保债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 9 月 29 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】2211 号文注册募集。本基金合同于 2015 年 11 月 16 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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年5月16日，有关财务数据和净值表现截止至2016年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国建设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	壹亿伍仟万元人民币
设立日期	2003年5月9日
组织形式	有限责任公司
法定代表人	叶焯
电话	021-61009999
传真	021-61009800
联系人	魏明东
存续期间	持续经营

经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
股权结构	股东名称	出资额	出资比例
	长江证券股份有限公司	7350 万元	49%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	34.33%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5 万元	16.67%
	总计	15000 万元	100%

(二) 主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
叶焯	董事长	男	中共党员，经济学硕士，中南财经大学工业经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。2015 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司董事长。曾任职君安证券有限公司石家庄营业部总经理、公司副总裁，国泰君安证券股份有限公司武汉分公司总经理、资产委托管理部总监，长信基金管理有限责任公司总经理，长城证券有限责任公司总经理，长江证券股份有限公司董事、总裁，长江证券承销保荐有限公司董事长。
陈谋亮	董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁。
邹继新	董事	男	中共党员，高级工程师，大学学历，硕士学位。现任武汉钢铁（集团）公司党委常委、副总经理、武汉钢铁股份有限公司总经理。曾任武汉钢铁股份有限公司三炼钢厂副厂长兼总工程师，武汉钢铁股份有限公司总经理助理兼武汉钢铁股份有限公司炼钢总厂厂长，武汉钢铁股份有限公司副总经理兼制造部部长，武汉钢铁（集团）公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。
覃波	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。曾任职于长江证券有限责任公司。2002年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
胡柏枝	独立董事	男	中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。
吴稼祥	独立董事	男	经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。
谢红兵	独立董事	男	中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险(香港)副董事长。
注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自2016年6月2日起，叶焯先生不再担任我公司董事长，由覃波先生代为履行董事长职务。			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司总会计师。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁(集团)公司计划财务部会计处处长、武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长、武汉钢铁股份有限公司副总会计师兼计划财务部部长。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理总裁特别助理。
杨爱民	监事	男	中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海

			欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。
注：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。
宋小龙	副总经理	男	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。2012年10月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会主任委员，兼任长信金利趋势混合基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
李小羽	副总经理	男	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格

		(CIM)。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、固定收益部总监，长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金和长信利广混合基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、总经理助理。
注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2016 年 5 月 24 日起，李小羽先生兼任长信利盈混合基金的基金经理； 3、自 2016 年 6 月 24 日起，李小羽先生不再担任公司固定收益部总监； 4、自 2016 年 6 月 28 日起，李小羽先生兼任长信利发债券基金的基金经理。		

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
李小羽	副总经理、固定收益部总监、基金经理	自基金合同生效之日起	简历同上
刘波	基金经理	自基金合同生效之日起	经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。2011 年 3 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理，现任长信可转债债券基金、长信利众债券基金（LOF）、长信新利灵活配置混合基金、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信利保债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金和长信利泰混合基金的基金经理。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。

注：1、自 2016 年 5 月 24 日起，刘波先生不再担任长信新利灵活配置混合基金的基金经理；

2、自 2016 年 5 月 24 日起，李小羽先生兼任长信利盈混合基金的基金经理；

3、自 2016 年 6 月 24 日起，李小羽先生不再担任公司固定收益部总监；

4、自 2016 年 6 月 28 日起，李小羽先生、刘波先生兼任长信利发债券基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理
宋小龙	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势混合基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理
谈洁颖	投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金的基金经理
李小羽	副总经理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信利广混合基金和长信金葵纯债一年定开债券基金的基金经理
薛天	国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信标普 100 等权重指数基金（QDII）的基金经理
黄建中	专户投资部投资经理、投资决策委员会执行委员
朱君荣	专户投资部副总监、投资经理
高远	研究发展部副总监
易利红	股票交易部副总监
张文琍	固定收益部副总监
注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2016 年 5 月 19 日起，薛天先生兼任长信海外收益一年定开债券基金（QDII）的基金经理； 3、自 2016 年 5 月 24 日起，李小羽先生兼任长信利盈混合基金的基金经理； 4、自 2016 年 6 月 24 日起，李小羽先生不再担任公司固定收益部总监，张文琍女士担任固定收益部总监，朱君荣先生调至量化投资部，不再担任专户投资部投资经理； 5、自 2016 年 6 月 28 日起，李小羽先生兼任长信利发债券基金的基金经理。	

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长5.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,052亿元，增长6.09%，其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年

“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投

资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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：叶烨	联系人：王瑞英
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
2、场外代销机构	
（1）中国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
（2）招商银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
法定代表人：李建红	联系人：邓炯鹏
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
（3）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
（4）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：杨泽柱	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
(5) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层	
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：钟兴
电话：0755-25832852	传真：0755-25831754
客户服务电话：400-888-1888	网址：www.firstcapital.com.cn
(6) 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
(7) 光大证券股份有限公司	
注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号	
办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号	
法定代表人：薛峰	联系人：刘晨
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
(8) 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：常喆	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
(9) 国金证券股份有限公司	
注册地址：成都市东城根上街 95 号	
办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
(10) 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

(11) 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
(12) 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
(13) 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
(14) 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
(15) 华龙证券股份有限公司	
注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼	
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦	
法定代表人：李晓安	联系人：邓鹏怡
电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
客户服务电话：4006898888	网址：www.hlzqgs.com.cn
(16) 平安证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼	
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	
法定代表人：杨宇翔	联系人：石静武
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511—8	网址：www.stock.pingan.com

(17) 中泰证券股份有限公司	
注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
法定代表人：李玮	联系人：王霖
电话：0531-68889155	传真：0531-68889752
客户服务电话：95538	网址：www.qlzq.com.cn
(18) 上海证券有限责任公司	
注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券	
办公地址：上海市西藏中路 336 号	
法定代表人：龚德雄	联系人：许曼华
电话：021-53519888	传真：021-53519888
客户服务电话：4008918918、021-962518	网址：www.962518.com
(19) 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.swhysec.com
(20) 天风证券股份有限公司	
注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
办公地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
法定代表人：余磊	联系人：翟璟
电话：027-87618882	传真：027-87618863
客服电话：028-86711410	网址：www.tfzq.com
(21) 天相投资顾问有限公司	
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	
法定代表人：林义相	联系人：尹伶
电话：010-66045529	传真：010-66045518
客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
(22) 兴业证券股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 268 号	
办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层	
法定代表人：兰荣	联系人：夏中苏
电话：021-38565785	
客户服务电话：400-8888-123	网址：www.xyzq.com.cn
(23) 中国银河证券股份有限公司	

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
法定代表人：陈有安	联系人：宋明
电话：010-66568888	传真：010-66568990
客户服务电话：4008-888-888	网址：www.chinastock.com.cn
(24) 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：北京市朝阳区朝阳门内大街 188 号	
法定代表人：王常青	联系人：张颢
电话：010-85130588	传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
(25) 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
(26) 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
(27) 西南证券股份有限公司	
注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号	
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦	
法定代表人：余维佳	联系人：张煜
电话：023-63786633	传真：023-63786212
客服热线：4008096096	网址：www.swsc.com.cn
(28) 杭州数米基金销售有限公司	
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
(29) 上海长量基金销售投资顾问有限公司	

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层	
法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
电话：021-20691832	传真：021-20691861
客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
(30) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室	
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801	
法定代表人：汪静波	联系人：徐诚
电话：021-38602377	传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
(31) 上海好买基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室	
法定代表人：杨文斌	联系人：苗汀
电话：021-58870011	传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
(32) 和讯信息科技有限公司	
注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
法定代表人：王莉	联系人：吴卫东
电话：021-68419822	传真：021-20835779
客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.com
(33) 上海天天基金销售有限公司	
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼	
法定代表人：其实	联系人：朱钰
电话：021-54509998	传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
(34) 上海汇付金融服务有限公司	
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼	
办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼	
法定代表人：冯修敏	联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611	传真：021-33323830
客户服务电话：4008202819	网址：www.chinapnr.com
(35) 上海陆金所资产管理有限公司	
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元	

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼	
法定代表人：郭坚	联系人：宁博宇
电话：021-20665952	传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031	网址：www.lufunds.com
(36) 大泰金石投资管理有限公司	
注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室	
办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼	
法定代表人：袁顾明	联系人：朱真卿
电话：021-22267943	传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266	网址：www.dtfortune.com
(37) 上海联泰资产管理有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼	
法定代表人：燕斌	联系人：陈东
电话：021-52822063	传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788	网址：www.66zichan.com
(38) 海银基金销售有限公司	
注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元	
办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼	
法定代表人：刘惠	联系人：毛林
电话：021-80133597	传真：021-80133413
客户服务电话：4008081016	网址：www.fundhaiyin.com
(39) 上海凯石财富基金销售有限公司	
注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室	
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼	
法定代表人：陈继武	联系人：葛佳蕊
电话：021-80365020	传真：021-63332523
客户服务电话：4006433389	网址：www.lingxianfund.com
3、场内销售机构	
场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： http://www.sse.com.cn	

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，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	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事务所

	限责任公司		
注册地址	北京市西城区太平桥大街17号	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	北京东长安街1号东方广场东2座8层
办公地址	北京市西城区太平桥大街17号	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	上海南京西路1266号恒隆广场50楼
法定代表人	金颖	廖海（负责人）	姚建华
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	崔巍	廖海、刘佳	王国蓓（王国蓓、虞京京为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信利保债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

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有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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（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%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

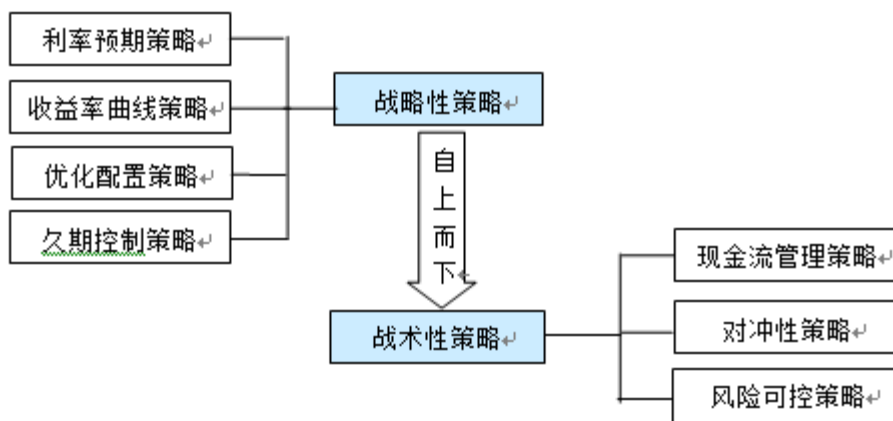
八、基金的投资策略

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

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。

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:三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%

如果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基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2016 年 3 月 31 日（摘自本基金 2016 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	486,821,545.69	19.17
	其中：股票	486,821,545.69	19.17
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,905,933,950.00	75.06
	其中：债券	1,905,933,950.00	75.06
	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	105,353,710.64	4.15
8	其他资产	41,059,854.60	1.62
9	合计	2,539,169,060.93	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港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	2,561,508.18	0.10
C	制造业	227,246,190.08	9.03
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	6,385,302.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	199,858,019.69	7.95
J	金融业	2,164,500.00	0.09
K	房地产业	15,690,383.00	0.62
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	5,480,062.00	0.22
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	5,961,759.00	0.24
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,941,453.00	0.08
S	综合	19,532,368.74	0.78
	合计	486,821,545.69	19.35

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港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	600895	张江高科	803,496	17,556,387.60	0.70
2	002268	卫士通	423,179	16,267,000.76	0.65
3	000988	华工科技	692,115	13,205,554.20	0.52
4	002308	威创股份	742,600	12,943,518.00	0.51
5	002609	捷顺科技	756,271	12,644,851.12	0.50
6	300024	机器人	222,134	12,561,677.70	0.50
7	300171	东富龙	602,400	12,035,952.00	0.48

8	002568	百润股份	452,106	11,564,871.48	0.46
9	300246	宝莱特	427,874	11,462,744.46	0.46
10	600745	中茵股份	403,700	10,734,383.00	0.43

(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	1,900,286,000.00	75.55
	其中：政策性金融债	1,900,286,000.00	75.55
4	企业债券	5,647,950.00	0.22
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,905,933,950.00	75.77

(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	140322	14进出22	4,000,000	411,040,000.00	16.34
2	150406	15农发06	2,000,000	204,320,000.00	8.12
3	150401	15农发01	1,800,000	184,050,000.00	7.32
4	140225	14国开25	1,600,000	164,032,000.00	6.52
5	140303	14进出03	1,500,000	160,980,000.00	6.40

(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

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

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

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

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	279,047.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	40,770,886.35
5	应收申购款	9,920.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	41,059,854.60

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600745	中茵股份	10,734,383.00	0.43	停牌或网下申购锁定期

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

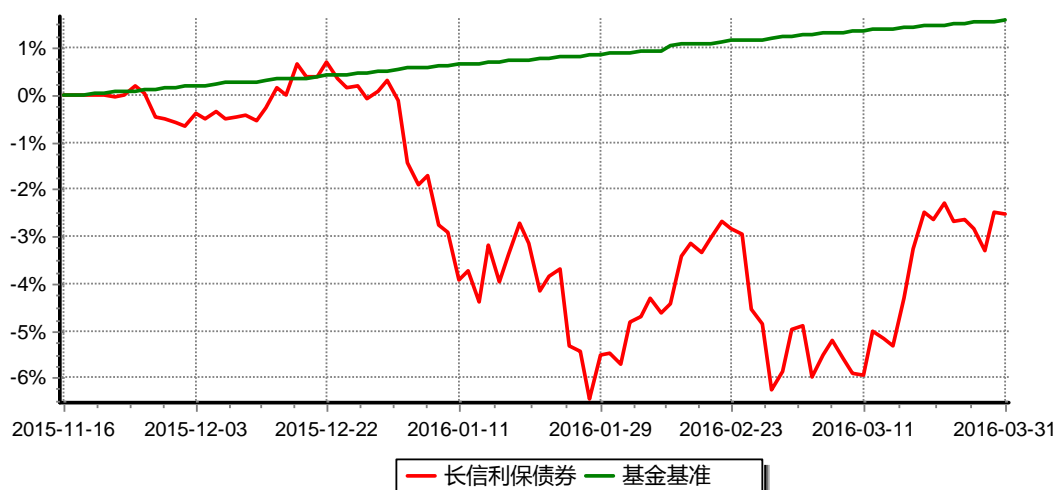
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表

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。

2016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：

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
2015年11月16日 -2015年12月31日	-0.10%	0.23%	0.53%	0.01%	-0.63%	0.22%
2016年1月1日 -2016年3月31日	-2.44%	0.73%	1.06%	0.02%	-3.50%	0.71%

自合同生效之日（2015年11月16日）至2016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、本基金基金合同生效日为2015年11月16日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年11月16日至2016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，本基金的各项投资比例将符合基金合同中的约定：投资于债券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%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

截至2016年3月31日，本基金尚未完成建仓。

十三、费用概况

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》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、诉讼费和仲裁费；
- 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、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。

（二）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。基金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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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。基金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 2 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“（一）基金费用的种类中第3—8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。

（三）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。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调低费率不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书（《长信利保债券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，对基金管理人主要人员情况进行了更新；

2、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料；

3、在“五、相关服务机构”部分的内容，更新了代销机构基本资料、会计师事务所联系人等信息；

4、在“六、基金的募集”部分，增加了基金募集的结果；

5、在“七、基金合同的生效”部分，增加了基金合同生效的信息；

6、在“八、基金份额的申购、赎回”部分，新增开通申购、赎回业务的时间，可转换的基金的情况以及更新了申购与赎回的数额限制；

7、增加了“十、基金投资组合报告”部分的相应内容；

8、增加了“十一、基金的业绩”部分相应内容，并经托管人复核；

9、更新了“二十二、基金份额持有人服务”中的部分内容；

10、更新了“二十三、其它应披露的事项”部分的相应内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年六月二十九日