长信增利动态策略股票型证券投资基金
更新的招募说明书
2011 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：中国民生银行股份有限公司

二〇一一年十二月

重 要 提 示

长信增利动态策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2006年8月28日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180号文核准募集。本基金基金合同于2006年11月9日正式生效。

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

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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2011年11月9日，有关财务数据和净值表现截止至2011年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国民生银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

目　　录

一、绪言 2
二、释义 3
三、基金管理人 6
四、基金托管人 17
五、相关服务机构 23
六、基金的募集 33
七、基金合同的生效 34
八、基金份额的申购与赎回 35
九、基金的投资 47
十、基金的投资组合报告 54
十一、基金的业绩部分 58
十二、基金的财产 60
十三、基金资产的估值 62
十四、基金收益与分配 69
十五、基金费用与税收 71
十六、基金的会计与审计 74
十七、基金的信息披露 75
十八、风险揭示 81
十九、基金合同的变更、终止和基金财产的清算 84
二十、基金合同的内容摘要 87
二十一、基金托管协议的内容摘要 101
二十二、基金份额持有人服务 116
二十三、其他应披露事项 119
二十四、招募说明书存放及查阅方式 121
二十五、备查文件 122

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关法律法规的规定，以及《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长信增利动态策略股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书的解释权由长信基金管理有限责任公司所有。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

二、释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

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

会员单位	指具有开放式基金代销资格经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的，可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位
销售机构	指基金管理人及基金销售代理人
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点
注册业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准设立的机构
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金达到法律规定及基金合同规定的基金备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指日常申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购或发售	指本基金在募集期内投资者购买本基金份额的行为
日常申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
日常赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
场外或柜台	指不通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
场内或交易所	指通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金

	交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	指投资者将其所持有的本基金管理人管理的任一开放式基金向本基金管理人提出申请将其原有基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为本基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
基金资产总值	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、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	上海市浦东新区银城中路 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	田丹		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	周宏		
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（涉及许可经营的凭许可证经营）		
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人员情况

董事会成员			
姓名	**职务**	**性别**	**简历**
田丹	董事长	男	中共党员，硕士，ＥＭＢＡ。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、

			总裁。现任长信基金管理有限责任公司董事长，兼长江证券股份有限公司第六届监事会监事长。
胡运钊	董事	男	中共党员，在职研究生学历，高级经济师。曾任湖北省经委工业处副处长、处长，黄石市人民政府副市长，中共黄石市委常委、常务副市长，湖北省人民政府副秘书长，省政府副秘书长兼办公厅主任、办公厅党组副书记，长江证券有限责任公司党委书记。现任长江证券股份有限公司董事长、党委书记。
王岑	董事	男	中共党员，硕士，高级工程师。曾任武汉钢铁（集团）公司热轧厂技术员、科长、车间副主任、厂长助理、副厂长、厂长，武汉钢铁（集团）公司总经理助理兼武汉钢铁有限责任公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼钢铁公司党委书记、副总经理， 武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。
李国洪	董事	男	硕士研究生学历。曾担任长江证券股份有限公司投资银行部业务主管，法律事务部经理，债权债务中心总经理，资产保全事业部总经理，办公室总经理，副总裁，合规总监。现任长江期货有限公司监事会主席。
徐文彬	董事	男	中共党员，本科学历。曾任步兵 273 团政治处主任，步兵 271 团政委，上海松江区建委书记，松江区小昆山镇和洞泾镇党委书记，上海海欣集团股份有限公司监事会主席、副总裁、总裁。现任上海海欣集团股份有限公司董事长、党委书记。
陈谋亮	董事	男	中共党员，博士，高级经济师，高级商务谈判师。曾任湖北经济学院讲师；扬子石化化工厂、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；上海交大南洋部门经理兼证券事务代表；上海海欣集团股份有限公司董事会秘书、总裁助理、战略投资管理部常务副总监、总监。现任上海海欣集团股份有限公司常务副总裁兼董事会秘书。
蒋学杰	董事	男	经济学硕士，澳大利亚墨尔本大学商学院 MBA。曾任中南财经大学财政金融学院财政系教师、武汉科技信托投资公司武昌证券营业部总经理，并兼公司总助，副总等职、Loftus Capital Partners Limited, Australia 旗下基金亚洲市场投资组合及私人股权投资的亚洲区域负责人、KVB Kunlun Pty Ltd, Australia 金融衍生产品持牌交易投资顾问、长信基金管理有限责任公司副总经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理。
朱恒	独立董事	男	中共党员，本科，高级经济师。曾任中国人民银行、中国农业银行上海市奉贤支行副行长，中国农业银行上海市分行副行长，上海浦东发展银行副行长，

			万国证券公司、申银万国证券公司董事长，上海浦东发展银行党委副书记、副行长，上海轻工控股（集团）公司监事会主席。
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。
黄宪	独立董事	男	中共党员，博士，博士生导师。曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师。
宋晓燕	独立董事	女	中共党员，法学博士，律师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。现任上海财经大学法学院教授。
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**
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科，正高职高级会计师。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。现任武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长。
柳杨	监事	男	硕士研究生学历。曾担任长江证券股份有限公司财务总部经理、总经理助理、副总经理、总经理、财务负责人兼财务总部主管。
王罗洁	监事	女	大学本科，高级会计师。曾任核工业部国营 792 矿统计员、计划科长，上海海欣股份有限公司财务副经理、经理、财务副总监等职。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部（筹）负责人。
刘耘	监事	女	中共党员，硕士。曾任湖北经贸实业公司暨大通（中国）国际运输有限责任公司湖北分公司会计主管、深圳蓝天基金管理公司暨武汉蓝天房地产发展有限公司财务部经理、武汉国有资产经营公司资产财务部副经理、长信基金管理有限责任公司基金事务部总监、市场开发部副总监。现任长信基金管理有限责任公司监察稽核部副总监。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	**职务**	**性别**	**简历**
蒋学杰	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。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。现任长信基金管理有限责任公司督察长。
付勇	副总经理	男	金融学博士，北京大学金融学专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾任中国建设银行个人金融业务部主任科员、华龙证券投资银行北京总部副总经理、东北证券北京总部总经理助理、东方基金副总经理。2006 年 1 月至 2010 年 2 月任东方基金公司东方精选混合型证券投资基金的基金经理，2008 年 6 月至 2010 年 2 月任东方基金公司东方策略成长股票型证券投资基金的基金经理。2010 年 3 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，兼任长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理。
覃波	副总经理	男	硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾在长江证券公司从事资产管理和债券承销发行工作。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，现任长信基金管理有限责任公司副总经理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

4、本基金基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	**职务**	**任职时间**	**简历**
胡志宝	公司投资总监、本基金和长信银利精选开放式证券投资基金的基金经理	2010 年 8 月 26 日至今	经济学硕士，南京大学国际贸易专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后担任国泰君安证券股份有限公司资产管理部基金经理、国海证券有限责任公司资产管理部副总经理、民生证券有限责任公司资产管理部总经理。2006 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司投资管理总部，从事投

			资策略研究工作。现任公司投资总监、本基金和长信银利精选开放式证券投资基金的基金经理。
曾 芒	基金经理	2006 年 11 月 9 日至 2010 年 8 月 26 日	曾任本基金的基金经理

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	**职务**
蒋学杰	总经理
付 勇	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理
叶 琦	总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监、长信量化先锋股票型证券投资基金的基金经理。
胡志宝	公司投资总监、投资决策委员会执行委员、长信银利精选开放式证券投资基金的基金经理、长信增利动态策略股票型证券投资基金的基金经理
钱 斌	研究发展部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李洪书	交易管理部副总监
李小羽	固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金的基金经理、长信中短债证券投资基金的基金经理
薛 天	国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金的基金经理
注：上述人员之间均不存在近亲属关系	

（三）内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况			
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。			
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会		
公司内部组织结构	金融工程部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、市场开发部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部、产品开发部		
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处		
员工总数	110 人（截至 2011 年 11 月 9 日）		
员工学历构成	**学历**	**人数**	**占比**
	博士	2 人	2%
	硕士	58 人	53%

	本科	42 人	38%
	专科	6 人	5%
	其它	2 人	2%
	总计	110 人	100%

（四）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托取得基金代销业务资格的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度、半年度和年度报告；

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格；

8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

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

12、法律法规和基金合同规定的其他职责。

（五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》及有关法律法规的行为，并承

诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止以基金财产从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；

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

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；

（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监督；

（6）玩忽职守、滥用职权；

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

（8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（9）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（10）贬低同行以抬高自己；

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（12）以不正当手段谋求业务发展；

（13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（14）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（六）基金管理人的内部控制制度

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

1、公司内部控制的总体目标

（1）保证公司经营管理活动的合法合规性；

（2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；

（3）实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；

（4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

2、内部控制制度遵循的原则

（1）合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。

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

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

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

（5）相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

（6）防火墙原则：公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕

信息的人员，应当制定严格的审批程序和监管措施。

（7）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

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

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

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

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

3、内部风险控制体系结构

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

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

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

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

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

监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

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

4、内部控制制度体系

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

第一个层面是公司章程。

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

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

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

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

5、内部风险管理体系

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

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

（1）投资风险管理；

（2）交易风险管理；

（3）巨额赎回风险管理；

（4）基金注册登记风险管理；

（5）基金核算风险管理；

（6）市场开发风险管理；

（7）信息披露风险管理；

（8）不可抗力风险管理。

6、风险管理和内部控制的措施

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

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

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

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

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

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

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

7、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：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：董文标

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字［2004］101 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：22,262,277,489 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：关悦

中国民生银行于 1996 年 1 月 12 日在北京正式成立，是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立十五年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了良好的资产质量。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，

规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

中国民生银行在“2006 民营上市公司 100 强”中位列第一名，并在市值、社会贡献两项分榜单中名列第一。

在《福布斯》中文版评选的“2006 中国顶尖企业十强榜”上，民生银行位列第七名。

2007 年 10 月，中国民生银行通过了 SAI 国际组织颁布的 SA8000 体系认证（即企业社会责任管理体系），成为中国金融界第一家通过该项认证的商业银行。

2007 年 11 月，民生银行获得 2007 第一财经金融品牌价值榜十佳中资银行称号，同时荣获《21 世纪经济报道》等机构评选的“最佳贸易融资银行奖”。

2007 年 12 月，民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区最大规模上市企业 50 强”奖项。

2008 年 7 月，民生银行荣获“2008 年中国最具生命力百强企业”第三名。在《2008 中国商业银行竞争力评价报告》中民生银行核心竞争力排名第 6 位，在公司治理和流程银行两个单项评价中位列第一。

2009 年 6 月，民生银行在 “2009 年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获 2009 年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009 年 9 月，在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上，中国民生银行被评为“2009 中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站评选”中，民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009 年度最佳银行网站”两项大奖。

2009 年 11 月 21 日，在第四届“21 世纪亚洲金融年会”上，民生银行被评为“2009 年·亚洲最佳风险管理银行”。

2009 年 12 月 1 日，中国民生银行获得了“2008 年度中国上市公司百强榜第 13 名”。

2009 年 12 月 9 日，在由《理财周报》主办的“2009 年第二届最受尊敬银行评

选暨 2009 年第三届中国最佳银行理财产品评选”中，民生银行获得了“2009 年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009 年最佳零售银行”多个奖项。

2010 年 2 月 3 日，在“卓越 2009 年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越 2009 年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010 年 5 月 20 日，在 2010 年英国《金融时报》中国银行业成就奖颁奖典礼上，中国民生银行从众多竞争者中脱颖而出，荣获“最佳贸易金融银行奖”。

2010 年 10 月，在经济观察报主办的“2009 年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓著的银行而特别设立的。

2010 年 12 月 1 日，在《亚洲货币》杂志(Asiamoney)公布的年度最佳公司治理票选结果中，民生银行在中国区组别中获得最高票数，成为年度中国区最佳公司治理企业。

2011 年 6 月 22 日，在由《理财周报》主办的“2011 中国上市公司最佳董事会价值管理论坛”上，民生银行荣获“2011 中国主板上市公司最佳董事会 10 强”。

2、主要人员情况

陈凌：女，高级会计师。资产托管部总经理。曾任职于中国有色金属工业总公司财务部，中国有色财务公司，招商银行北京分行，中国民生银行股份有限公司总行营业部、北京管理部、西安分行、总行年金筹备组；历任中国有色财务公司处长，中国民生银行股份有限公司总行营业部副主任、北京管理部副总经理、西安分行行长、总行年金筹备组组长等职务。具有丰富的大型企业集团、非银行金融机构及商业银行的从业工作经历和管理工作经验。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 43 人，平均

年龄 35 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。截止到 2011 年 9 月 30 日，本行共托管基金 11 只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金和工银瑞信添颐债券型证券投资基金。托管基金资产净值为 358.27 亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2、内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司稽核部、资产托管部内设稽核监督处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的内部监督稽核处，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务处室风险控制工作的实施。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监督处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机

制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4、内部风险控制制度和措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：稽核监督处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务处室和业务岗位，

每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多处室制的内部组织结构，形成不同处室、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职稽核监督处，依照有关法律规章，每两个月对业务的运行进行一次稽核检查。总行稽核部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心九楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心九楼	
法定代表人：田丹	联系人：孙赵辉
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
2、场外代销机构	
（1）中国农业银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
法定代表人：项俊波	联系人：滕涛
电话：010-85108229	传真：010-85109219
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
（2）中国银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
法定代表人：肖钢	
客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
（3）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：郭树清	
客户服务电话:95533	联系人：张静
传真：010-66275654	网址：www.ccb.com
（4）交通银行股份有限公司	
注册地址：上海市银城中路 188 号	
办公地址：上海市银城中路 188 号	
法定代表人：胡怀邦	联系人：曹榕
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
（5）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：傅育宁	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
（6）上海浦东发展银行股份有限公司	
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 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：徐伟、虞谷云
电话：021-61618888	传真：021-63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
（7）兴业银行股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦	
办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦	
法定代表人：高建平	联系人：曾鸣
电话：0591-87839338	传真：0591-87841932
客户服务电话：95561	网址：www.cib.com.cn
（8）中国民生银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号	
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号	
法定代表人：董文标	联系人：董云巍、吴海鹏
电话：010-58351666	传真：010-83914283
客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
（9）中信银行股份有限公司	
注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
法定代表人：田国立	
电话：010-65557083	联系人：丰靖
客户服务电话：95558	公司网址：bank.ecitic.com
（10）华夏银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
法定代表人：吴建	联系人：郑鹏
电话：010-85238667	传真：010-85238419
客户服务电话：010-95577	公司网址：www.hxb.com.cn
（11）汉口银行股份有限公司	

注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：骆芸
电话：027-82656224	传真：027-82656236
客户服务电话：（027）96558,4006096558	公司网址：www.hkbchina.com
（12）深圳发展银行股份有限公司	
注册地址： 深圳市罗湖区深南东路 5047 号	
办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦	
法定代表人： 肖遂宁	传真：0755-25841098
客户服务电话：95501	网址：www.sdb.com.cn
（13）杭州银行股份有限公司	
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
法定代表人：吴太普	联系人：严峻
电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
客户服务电话：96523，400-8888-508	公司网址：www.hzbank.com.cn
（14）重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：96899，400-709-6899	网址：www.cqcbank.com
（15）安信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
法定代表人：牛冠兴	联系人：俞江
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn
（16）长城证券有限责任公司	
注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
法定代表人：黄耀华	联系人：匡婷
电话：0755-83516289	传真：0755-83516199
客户服务电话：400-6666-888	网址：www.cgws.com
（17）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：胡运钊	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
（18）大通证券股份有限公司	
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号	
办公地址：辽宁省大连市中山区延安路 1 号保嘉大厦 15-16 层	
法定代表人：于宏民	联系人：谢立军
电话：0411-39673202	传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169	网址：www.daton.com.cn
（19）德邦证券有限责任公司	
注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼	
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼	
法定代表人：方加春	联系人：罗芳
电话：021-68761616	传真：021-68767981
客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn
（20）东方证券股份有限公司	
注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 层	
办公地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 层	
法定代表人：潘鑫军	联系人：吴宇
电话：021-63325888	传真：021-63326786
客户服务电话：95503	网址：www.dfzq.com.cn
（21）东吴证券股份有限公司	
注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦	
办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦	
法定代表人：吴永敏	联系人：方晓丹
电话：0512-65581136	传真：0512-65588021
客户服务电话：0512-33396288	网址：www.dwzq.com.cn
（22）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：徐浩明	联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：4008888788、10108998	网址：www.ebscn.com
（23）华福证券有限责任公司	
注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	
法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）	网址：www.hfzq.com.cn
（24）广发证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
法定代表人：王志伟	联系人：黄岚
电话：020-87555888 转各营业网点	传真：020-87557985
客户服务电话：95575 或致电各地营业部	网址：www.gf.com.cn
（25）国都证券有限责任公司	
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 楼 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 楼 10 层	
法定代表人：常喆	联系人：黄静
电话：010-84183389	传真：010-84183311-3389
客户服务电话：400-818-8118	网址：www.guodu.com
（26）国金证券股份有限公司	
注册地址：成都市东城根上街 95 号	
办公地址：成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：金喆
电话：028-86690126	传真：028-86690126
客户服务电话：4006600109	网址：www.gjzq.com.cn
（27）国联证券股份有限公司	
注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号	
办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼	
法定代表人：雷建辉	联系人：徐欣
电话：0510-82831662	传真：0510-82830162
客户服务电话：4008885288	网址：www.glsc.com.cn
（28）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：曾小普	联系人：吴祖平
电话：0791-6281061	传真：0791-6281061
客户服务电话：4008-222-111	网址：www.gsstock.com
（29）国泰君安证券股份有限公司	
注册地址：上海市浦东新区商城路 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：万建华	联系人：芮敏祺
电话：021-38676666	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
（30）国信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com
（31）海通证券股份有限公司	
注册地址：上海市淮海中路 98 号	
办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦	
法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
电话：021-23219000	传真：021-23219100
客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
（32）宏源证券股份有限公司	
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦	
办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券	
法定代表人：冯戎	联系人：李巍
电话：010-88085858	传真：010-88085195
客户服务电话：4008-000-562	网址：www.hysec.com
（33）华安证券有限责任公司	
注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号	
办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层	
法定代表人：李工	联系人：甘霖
电话：0551-5161666	传真：0551-5161600
客户服务电话：96518、400-80-96518	网址：www.hazq.com
（34）华宝证券有限责任公司	
注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层	
办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层	
法定代表人：陈林	联系人：陈康菲
电话：021-50122222	传真：021-50122218
客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
（35）华龙证券有限责任公司	
注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号	

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：李昕田
电话：0931-4890100	传真：0931-4890118
客户服务电话：0931-8730264	网址：www.hlzqgs.com
（36）华泰联合证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层	
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层	
法定代表人：马昭明	联系人：盛宗凌、庞晓芸
电话：0755-82492000	传真：0755-82492962
客户服务电话：95513	网址：www.lhzq.com
（37）华泰证券股份有限公司	
注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
法定代表人：吴万善	联系人：樊昊
电话：0086-25-84457777	传真：0086-25-84579763
客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
（38）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：张宇宏
电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
客户服务电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
（39）中航证券有限公司	
注册地址：南昌市抚河北路 291 号	
办公地址：南昌市抚河北路 291 号教育出版大厦 904 室	
法定代表人：杜航	联系人：余雅娜
电话：0791-6768763	传真：0791-6770178
客户服务电话：400-8866-567	网址：www.avicsec.com
（40）齐鲁证券有限公司	
注册地址：山东省济南市经十路 20518 号	
办公地址：山东省济南市经十路 20518 号	
法定代表人：李玮	联系人：吴阳
电话：0531-81283938	传真：0531-81283900
客户服务电话：95538	网址：www.qlzq.com.cn
（41）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：郁忠民	联系人：张瑾
电话：021-53519888	传真：021-53519888
客户服务电话：4008918918、021-962518	网址：www.962518.com
（42）天风证券有限责任公司	
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
（43）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：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层	
法定代表人：林义相	联系人：林爽
电话：010-66045608	传真：010-66045500
客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
（44）天源证券经纪有限公司	
注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼	
办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼	
法定代表人：裴东平	联系人：关键
电话：0755-33331188-8101	传真：0755-33329815
客户服务电话：400-65432-18	网址：www.tyzq.com.cn
（45）西藏同信证券有限责任公司	
注册地址：拉萨市北京中路 101 号	
办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号	
法定代表人：贾绍君	联系人：王伟光
电话：021-36533016	传真：021-36533017
客户服务电话：400-8811-177	网址：www.xzsec.com
（46）湘财证券有限责任公司	
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼	
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
法定代表人：林俊波	联系人：钟康莺
电话：021-68634518	传真：021-68865680
客户服务电话：400-888-1551	网址：www.xcsc.com
（47）兴业证券股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 268 号	

办公地址：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：谢高得
电话：021-38565785	
客户服务电话：400-8888-123	网址：www.xyzq.com.cn
（48）招商证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 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：林生迎
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
（49）中国民族证券有限责任公司	
注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	
办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	
法定代表人：赵大建	联系人：姜建平
电话：010-59355543	传真：010-66553791
客户服务电话：40088-95618	网址：www.e5618.com
（50）中国银河证券有限责任公司	
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：顾伟国	联系人：田薇
电话：010-66568888	传真：010-66568536
客户服务电话：4008-888-888	网址：www.chinastock.com.cn
（51）中信建投证券有限责任公司	
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号	
法定代表人：张佑君	联系人：权唐
电话：010-85130588	传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
（52）中信证券股份有限公司	
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层	
办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层	
法定代表人：王东明	联系人：陈忠
电话：010-84683893	传真：010-84685560
客户服务电话：95558	网址：www.citics.com
3、场内销售机构	
场内代销机构是指有资格的上证所会员，名单详见上海证券交易所网站：	

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjjt.jsp

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）与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

信息类型	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事务所
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	陈耀先	廖海（负责人）	萧伟强
联系电话	010-59378839	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	朱立元	廖海、吴军娥（已离职）	彭成初（江雯、黄小熠为经办注册会计师）

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，并经中国证监会 2006 年 8 月 28 日证监基金字【2006】180 号文核准募集。

本基金募集期为 2006 年 9 月 18 日至 2006 年 11 月 3 日。经毕马威华振会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集 580,617,102.63 份基金份额，有效认购户数为 6,507 户。

七、基金合同的生效

（一）根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定，本基金符合基金合同生效的条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2006 年 11 月 9 日获得证监会书面确认，基金合同从即日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产额

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元人民币的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的场所

1、基金管理人的直销网点。

2、不通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外基金销售机构：详见“五、相关服务机构之代销机构”。

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

3、通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的会员单位。

投资者可通过上述场所按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况增减销售机构，并予以公告。

4、投资者也可通过本基金管理人或者指定基金销售代理人提供的其他方式（例如：电话、传真或网上交易）办理基金的申购与赎回。

5、投资者还可登陆本公司网站（www.cxfund.com.cn），在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过本公司网上交易系统办理开户、申购等业务（目前本公司仅对个人投资者开通网上交易服务）。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应对投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种证监会指定的媒体上公告。

2、申购的开始时间及业务办理时间

本基金的申购自基金合同生效日后不超过 3 个月时间里开始办理，本基金（前端代码：519993，后端代码：519992）已于 2006 年 11 月 27 日开始办理日常申购业务。受理时间为：9：00-11：30、13：00-15：00，如各销售机构办理时间有所不同，请参照各销售机构的规定。

本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购业务。

3、赎回的开始时间及业务办理时间

本基金已于 2007 年 2 月 8 日开始办理日常赎回业务。受理时间为：9：00-11：30、13：00-15：00，如各销售机构办理时间有所不同，请参照各销售机构的规定。

（三）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者申（认）购的先后次序进行顺序赎回。

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。

（四）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

本基金的申购和赎回采取书面形式、电话、或基金销售机构同意的其他交易形式。基金投资者必须按基金销售机构规定的手续向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资者申请赎回时，其在销售机构必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购和赎回的成交情况。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人在 T＋7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

（五）申购和赎回的数额约定

1、代销网点每次申购本基金的最低金额为 1,000 元（如选择前端收费模式，含申购费）。若代销机构有关于交易级差规定的，以代销机构的规定为准。

直销网点首次申购本基金的最低金额为 10 万元（如选择前端收费模式，含申购费），追加申购的最低金额为 1,000 元。已在直销网点有该基金认购记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。在本公司网上交易系统可接受个人投资者单笔申购金额在 1,000 元人民币以上（含 1,000 元）的申购申请。具体申购限额以投资者指定结算机构的规定为准。

代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。

投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回本基金时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。

4、申购份额及余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在

扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

6、基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

（六）申购费率和赎回费率

1、申购费

（1）投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（2）投资者选择交纳前端申购费用时，采用外扣法计算。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	1.50%
100 万≤M＜500 万	1.00%
M≥500 万	1000 元

上述费率为 2008 年 6 月 2 日开始的调整后的费率，详见 2008 年 5 月 20 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下股票基金交易手续费费率的公告》。

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。

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

持有时间（N，年）	后端申购费率
N＜1 年	1.8%
1 年≤N＜3 年	1.2%
3 年≤N＜5 年	0.6%
N≥5 年	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。

2、赎回费

本基金的赎回费用再投资人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，具体费率如下：

持有时间（N，年）	赎回费率
N＜1 年	0.5%
1 年≤N＜2 年	0.3%
N≥2 年	0

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在《基金合同》约定的范围内，基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

4、本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时，将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（七）赎回费的归属

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，本基金赎回费的 25%归入基金财产所有。

（八）申购份额和赎回金额的计算

1、申购份额的计算公式

（1）前端收费模式

净申购金额＝申购金额 /（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日基金份额净值

例 1：某投资者投资 1 万元申购长信增利动态基金，假设申购当日基金份额净值为 2.0000 元，采用前端收费模式，对应的申购费率为 1.5%，则可得到的申购份额为：

申购金额	申购费率	净申购金额	申购费用	基金份额净值	申购份数
10,000 元	1.5%	9,852.22 元	147.78 元	2.0000 元	4,926.11 份

（2）后端收费模式

申购份额=申购金额/T 日基金份额净值

例 2：某投资人投资 1 万元申购长信增利动态策略基金，采用后端收费模式，假定申购当日基金份额净值为 1.1 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	基金份额净值	申购份数
10,000 元	1.100 元	9,090.91 份

（3）申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金财产。

2、赎回金额的计算

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

（1）前端收费模式

如果投资者在申购（认购）时选择交纳前端申购（认购）费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

（2）后端收费模式

如果投资者在申购（认购）时选择交纳后端申购（认购）费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

后端申购（认购）费用=赎回份额×申购日基金份额净值（基金份额面值）×后端申购（认购）费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－后端申购（认购）费用-赎回费用

例 3：某投资者赎回持有期未满一年的长信增利动态策略基金 1 万份，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1 元，其在申购时已交纳前端申购费用，则其赎回费用和可得到的赎回金额为：

赎回份额	赎回费率	赎回总额	赎回费用	赎回当日基金份额净值	赎回金额
10,000 份	0.5%	11,000 元	55 元	1.100 元	10,945 元

例 4：假定某投资者申购本基金份额当日的基金份额净值为 1.1 元，该投资者选择交纳后端申购费用，并在持有期未满一年时赎回 1 万份，对应的赎回费率为 0.5%，对应的后端申购费率为 1.8%，假设赎回当日基金份额净值是 1.2 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回份额	赎回当日基金份额净值	赎回总额	申购当日基金份额净值	后端申购费率	后端申购费用	赎回费率	赎回费用	赎回金额
10,000 份	1.200 元	12,000 元	1.100 元	1.8%	198 元	0.5%	60 元	11,742 元

（3）赎回金额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金财产。

3、基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值＝基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数。

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

（九）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。

（十）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金资产净值；

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

4、法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。；

5、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的基金申购；

发生上述 1 至 4 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

（十一）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

2、证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续两个开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、法律法规、本基金合同规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在至少一种证监会指定媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定媒体及基金管

理人网站刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

（十二）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金在单个开放日内，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按其赎回申请量占当日赎回申请总量的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 2 个交易日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，或以邮寄、传真等方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付

时间 20 个工作日，并应当在至少一种证监会指定媒体及基金管理人网站上公告。

（十三）重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购和赎回时，基金管理人应提前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（十四）基金的转换

本公司已开通了长信增利动态股票基金（前端代码：519993）与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998）、长信金利趋势股票基金（前端代码：519995）、长信银利精选股票基金（前端代码：519997）、长信利丰债券基金、长信双利优选混合基金、长信恒利优势股票基金、长信中短债基金和长信量化先锋股票基金之间实现双向转换。长信增利动态股票基金（后端代码：519992）可转换转入长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998）。

1、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)

2、本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时，将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

（十五）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金份额转入手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管转入手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

（十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布的公告或更新的招募说明书中确定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十七）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法执行等情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”只受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律和基金合同规定的持有本基金份额的条件。办理非交易过户必须提供相关资料。

投资者办理非交易过户须到基金注册登记机构处办理。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。

（十八）基金的冻结

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金对上市公司股票按照价值型与成长型进行风格划分，通过对证券市场未来走势的综合研判灵活配置两类风格的股票，从而在风险适度分散并保持组合流动性的基础上超越比较基准，获得长期增值回报。

（二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行并上市的股票(含新股配售与增发)、权证、债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票包括所有在交易所上市的 A 股；债券包括国债、金融债、企业债、可转债等；货币市场工具包括各种回购、央行票据、短期融资券、同业存款以及剩余期限在 1 年以内的短期债券等。

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

（三）投资策略

本基金采用目前国外比较流行的风格轮换策略，以经过品质筛选的沪深 A 股为基本股票池，根据股票风格管理系统对个股进行风格分类，在量化分析的基础上对价值型和成长型两类风格股票进行主动投资，以获得超过比较基准的持续回报。

投资策略方面，本基金采用自上而下和自下而上相结合的策略结构。基金投资策略体系自上而下分为 3 个层面：战略配置、风格配置和个股选择。本基金为股票型基金，在整个投资体系中，本基金将重点放在风格配置和个股选择层面，这两个层面对基金收益的贡献程度约占 80%，战略配置对基金收益的贡献程度约占 20%。在风格配置和个股选择层面，本基金将以风格轮换策略为主，辅以多层次个股选择，形成基金最后的投资组合。在投资过程中，本基金的股票风格管理系统和风险控制绩效量化管理平台将提供量化分析方面的决策支持。

（四）资产配置

本基金资产投资于股票类资产的比例范围是 60%—95%；投资于债券类资产的比例范围是 0%—35%；投资于货币市场工具的比例范围是 5%—40%（其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例将由基金管理人根据具体情况进行主动调整，但配置比例不超出上述限定范围。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行相关程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

表:长信增利动态策略基金资产配置比例

资产类别	投资对象	资产配置下限(%)	资产配置上限(%)
股票类资产	所有在国内依法发行的 A 股、权证	60	95
债券类资产	国债、金融债、企业债(包括可转债)、资产支持证券等。	0	35
货币市场工具	银行存款、各种回购、央行票据、同业存款、短期融资券及剩余期限在 1 年以内的短期债券等	5	40

（五）风格资产配置

历史数据表明，成长型、价值型两种风格的股票群分别在牛市、熊市的市场环境下有相对更好的市场表现。本基金将结合对宏观经济、市场环境的研判和量化分析平台的决策支持确定基金投资组合的风格配置。

具体而言，本基金的风格配置流程包括以下几个方面：

A、根据股票风格管理系统对上市公司股票进行风格划分；

B、通过对宏观经济周期、通货膨胀水平、资金供求关系等多个因素的判断和对价值风格指数、成长风格指数、市场综合指数的量化分析与比较，进行基金的风格配置转换决策。

C、参考比较基准中各种风格股票群的相对配置比例，采用定性与定量分析相结合的方法确定投资组合最终的风格配置水平。

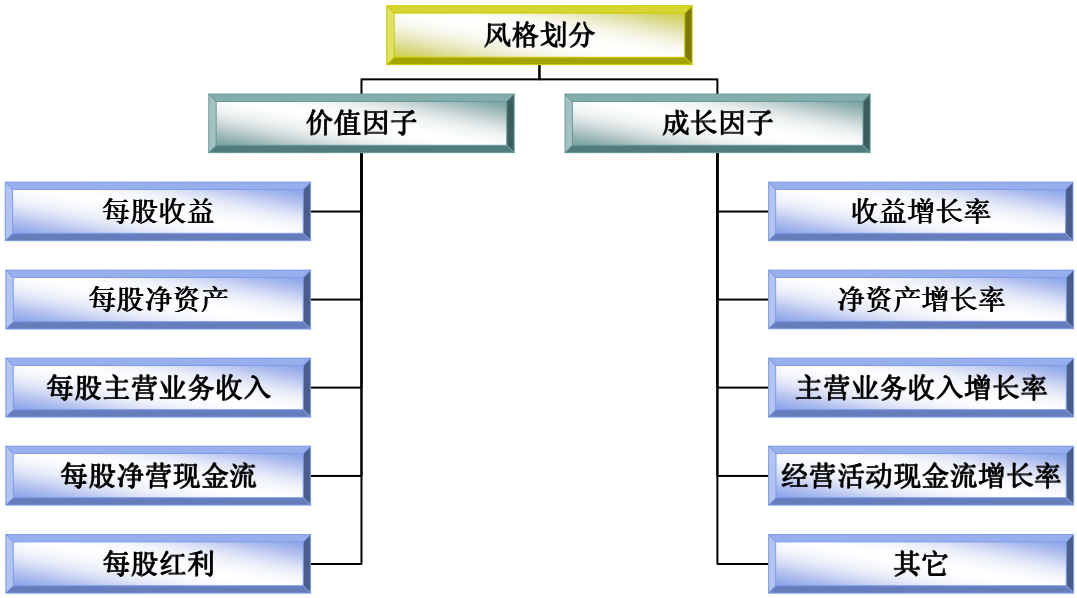
1、风格划分

本基金的股票风格管理系统首先对价值型和成长型因子的影响因素进行判别分析，确定风险因子及其权重，然后对个股的价值评分和成长评分算术平均，得到

每只股票相对应的风格评分，最后对经过品质筛选后的基金股票池中的股票按照风格评分由大到小进行排序。本基金将排名较前的股票确认为成长股；将排名较后的股票确认为价值股；剩余的股票为平衡股。

影响股票风格的因子有很多，本基金的股票风格管理系统选取的价值因子包括股票每股收益、每股净资产、每股主营业务收入、每股经营活动现金流净额、每股现金红利等因素；选取的成长因子包括每股收益增长率、每股净资产增长率、每股主营业务收入增长率、每股经营活动现金流净额增长率等因素。

图：长信增利动态策略基金股票风格管理系统



2、风格配置转换决策

本基金采用从定性分析和定量分析两个层面进行风格配置的转换决策。转换决策的原理主要有两个：(I) 在牛市、熊市重点配置成长型、价值型的股票；(II) 根据市场数据和股票的风格划分编制成长风格指数和价值风格指数，根据两种指数的相对表现权衡两种风格的配置转换。

3、风格配置水平的决定

风格轮换策略是本基金股票资产配置的主要策略，在对市场演变趋势和风格指数相对表现进行综合分析的基础上，基金经理将以获得超额收益为目标确定两类风格资产的具体配置比例。其中配置比例的决定参考两个层面的决策支持：一是市场比较基准中两类风格股票的基准配置比例；二是根据风格指数的历史数据对风格资

产进行优化配置。

在参考基准配置比例并限制偏离幅度的前提下，本基金将根据风格指数的历史表现和未来预期对风格资产进行优化配置。风格指数是表征价值类股票和成长类股票历史综合走势的曲线，通过分析风格指数的预期收益和风险水平，本基金采用均值－方差方法对风格类型进行优化配置，以在一定的风险水平和配置比例约束下实现投资组合期望收益的最大化。

（六）股票选择

本基金投资于具有良好流动性的股票，在投资范围上，本基金将经过品质筛选的沪深 A 股作为基金投资的基础股票池。在保持组合具有良好流动性的前提下，本基金通过个股品质过滤、公司价值评估、企业素质评价、市场演变趋势等环节的分析和判断，确定投资组合中最终投资的个股。

（七）债券投资

为降低基金投资组合的系统性风险，本基金将适度投资于债券类资产。债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性，在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上，灵活运用各种投资策略，实现基金资产的保值增值。

在个券选择上，本基金将综合运用利率预期、信用等级分析、到期收益率分析、流动性评估等方法来评估个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

1、有较高信用等级的债券；

2、在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，到期收益率较高的债券；

3、有良好流动性的债券；

4、风险水平合理、有较好下行保护的债券。

（八）业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分为上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为：

沪深 300 指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×30%

如果将来出现更合适的业绩比较基准，本基金将根据实际情况适当调整业绩比较基准，并在报送监管机构后予以公布。

（九）风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

（十）投资决策依据

1、国家有关法律法规和本《基金合同》的有关规定；

2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等；

3、国家财政政策、货币政策、产业政策，以及利率走势、通货膨胀预期等；

4、股票、债券、衍生产品等类别资产的预期收益率及风险水平。

（十一）投资程序

本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1、研究发展部、固定收益部提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析、行业分析和上市公司研究等各类报告和投资建议，为投资运作提供决策支持；

2、投资决策委员会对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析，制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策；

3、基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下，拟定投资方案；

4、投资决策委员会委员对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；

5、基金经理根据决策纪要构造具体的投资组合及操作方案，交由交易管理部执行；

6、金融工程部定期对基金投资组合进行绩效和风险评估，并提出风险控制意见；

7、基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

（十二）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

4、本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

5、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

6、本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定。

7、本基金投资资产支持证券的，本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外。

8、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述1-3项以及5-8项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（十三）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

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

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（十四）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（十五）基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

十、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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 11 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止至 2011 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）本期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,437,333,670.30	90.47
	其中：股票	2,437,333,670.30	90.47
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	254,053,945.37	9.43
6	其他资产	2,571,521.74	0.10
7	合计	2,693,959,137.41	100.00

（二）股票投资组合

1、按行业分类的股票投资组合

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	27,165,664.42	1.01
B	采掘业	127,102,747.10	4.73
C	制造业	1,292,198,501.43	48.10
C0	食品、饮料	306,623,553.93	11.41

C1	纺织、服装、皮毛		
C2	木材、家具		
C3	造纸、印刷		
C4	石油、化学、塑胶、塑料	192,833,748.98	7.18
C5	电子	54,543,029.83	2.03
C6	金属、非金属	225,563,911.01	8.40
C7	机械、设备、仪表	286,115,235.63	10.65
C8	医药、生物制品	226,519,022.05	8.43
C99	其他制造业		
D	电力、煤气及水的生产和供应业		
E	建筑业	143,780,554.46	5.35
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	236,152,674.73	8.79
H	批发和零售贸易	223,513,778.29	8.32
I	金融、保险业	164,489,803.53	6.12
J	房地产业	121,028,783.52	4.50
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	33,521,573.56	1.25
M	综合类	68,379,589.26	2.55
	合计	2,437,333,670.30	90.72

2、基金投资前十名股票明细

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	600000	浦发银行	11,674,686	99,701,818.44	3.71
2	600537	海通集团	2,949,841	80,235,675.20	2.99
3	600690	青岛海尔	8,610,072	79,040,460.96	2.94
4	000568	泸州老窖	1,810,244	70,418,491.60	2.62
5	600176	中国玻纤	3,599,882	69,981,706.08	2.60
6	000063	中兴通讯	3,540,967	66,924,276.30	2.49
7	000858	五 粮 液	1,799,842	65,334,264.60	2.43
8	601318	中国平安	1,929,937	64,787,985.09	2.41
9	600519	贵州茅台	329,944	62,884,026.96	2.34
10	000039	中集集团	3,570,965	55,992,731.20	2.08

（三）债券投资组合

1、按投资品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券相关品种。

2、基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券相关品种。

（四）权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证。

（五）资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（六）报告附注

1、报告期内中国证券监督管理委员会于2011年4月29日发布《中国证监会行政处罚决定书（五粮液、唐桥等8名责任人员）》（2011【17】号），对五粮液（000858）的《澄清公告》存在重大遗漏，信息披露不及时、不完整等行为给予警告并处以60万元罚款等行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该行政处罚事件发生后，本基金管理人对上市公司进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体内其余九名未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,196.74
5	应收申购款	20,325.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,571,521.74

4、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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

十一、基金的业绩部分

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

基金 2011 年第三季度及历史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
2007年	152.23%	1.92%	98.52%	1.61%	53.71%	0.31%
2008年	-52.72%	2.36%	-50.46%	2.13%	-2.26%	0.23%
2009年	42.98%	1.59%	62.82%	1.43%	-19.84%	0.16%
2010年	-6.84%	1.26%	-7.46%	1.11%	0.62%	0.15%
2011年1月1日至2011年6月30日	-6.50%	1.20%	-1.18%	0.86%	-5.32%	0.34%
2011年7月1日至2011年9月30日	-15.78%	1.24%	-10.54%	0.93%	-5.24%	0.31%

自合同生效之日（2006 年 11 月 9 日）至 2011 年 9 月 30 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、图示日期为2006年11月9日至2011年9月30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已符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：股票类资产占基金资产总净值比例为60%-95%，债券类资产占基金资产总净值比例为0-35%，货币市场工具占基金资产总净值比例为5-40%。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

1、银行存款及其应计利息；

2、清算备付金及其应计利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金；

4、应收证券交易清算款；

5、应收申购款；

6、股票投资及其估值调整；

7、债券投资及其估值调整和应计利息；

8、其他投资及其估值调整；

9、其他资产等。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

其构成主要有：

1、基金份额持有人申购基金份额所支付的款项；

2、运用基金资产所获得收益（亏损）；

3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

（三）基金财产的账户

本基金以基金名义开立银行托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“长信增利动态策略股票型开放式证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“长信增利动态策略股票型开放式证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、

基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。

6、除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

7、基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回的基础。

（二）估值日

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

（三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

（四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的有关规定，对估值日无市价，但存在活跃市场的投资品种，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，采用指数收益法估值。

（2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可

靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值办法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（5）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值办法：

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（3）项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（3）项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成

一致的意见，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（五）估值程序

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

（六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

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

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

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

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承

担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

4、基金份额净值差错处理的原则和方法

（1）当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（七）暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会认定的其他情形。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 1（4）项、第 2（8）项和第 3（5）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

十四、基金收益与分配

（一）收益的构成

本基金的收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

5、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月不进行收益分配；

7、基金每年分红次数最多不超过12次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的80%。若年度分红12次后，基金再次达到分红条件，则可分配收益滚存到下一年度进行分配。

8、本基金根据基金净值的表现采用程序化的收益分配机制：

（1）本基金合同生效后进行第一次收益分配的启动条件是基金净值相对于面值累计涨幅超过10%且每份基金份额的可分配收益不低于0.01元。基金管理人将在

本基金满足上述条件之日起10个工作日内提出分红方案。

（2）本基金进行日常收益分配的启动条件是基金净值相对于前次基金分红后净值的累计涨幅超过10%且每份基金份额的可分配收益不低于0.01元，同时距离基金前次分红的时间不少于10个工作日；一旦条件满足，基金管理人将在本基金满足上述条件之日起10个工作日提出分红方案。

9、若基金份额净值相对于面值或者前次基金分红后净值的累积涨幅未超过10%，在满足法律法规的前提下，基金也可以根据市场情况进行收益分配。

10、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响投资人利益的情况下，基金管理人可酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但最迟应于变更实施日2日前在指定媒体及基金管理人网站公告。

（四）收益分配方案

本基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核， 2 日内在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

（六）收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资者的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照长信基金管理有限责任公司开放式基金有关业务规定执行。

十五、基金费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用列示

（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；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券交易费用；

（7）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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的 1.5%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5‰的年费率计提，计算方法如下：

H=E×2.5‰÷当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金

托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（3）上述“1、与基金运作有关费用列示”中（3）－（8）项费用由基金托管人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，从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金认购费用

基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“六、基金的募集”相应部分。

2、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”相应部分。

3、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”相应部分。

4、转换费用

基金转换费用的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”相应部分。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

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

（二）基金的年度审计

1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案。更换会计师事务所应在 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。

十七、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（一）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管

人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（2）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申

购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

（1）基金份额持有人大会的召开；

（2）终止《基金合同》；

（3）转换基金运作方式；

（4）更换基金管理人、基金托管人；

（5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；

（7）基金募集期延长；

（8）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托

管人基金托管部门负责人发生变动；

（9）基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

（10）基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；

（11）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

（12）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

（13）基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

（14）重大关联交易事项；

（15）基金收益分配事项；

（16）管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（17）基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

（18）基金改聘会计师事务所；

（19）变更基金份额发售机构；

（20）基金更换注册登记机构；

（21）本基金开始办理申购、赎回；

（22）本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

（23）本基金发生巨额赎回并延期支付；

（24）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

（25）本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

（26）中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持

有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

10、中国证监会规定的其他信息。

（二）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

（三）信息披露文件的存放与查阅

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，供公

众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十八、风险揭示

本基金是一只主动投资的股票型基金，通过对上市公司股票按照价值型与成长型进行风格划分，通过对证券市场未来走势的综合研判灵活配置两类风格的股票，从而在风险适度分散并保持组合流动性的基础上超越比较基准，获得长期增值回报。

（一）投资于长信增利动态策略股票型证券投资基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

（2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

（4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

（5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金财产损失。

3、债券收益率曲线变动风险。

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、再投资风险。

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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

8、合规性风险

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

9、本基金的特定风险

本基金作为股票型基金，在基金投资中根据基金对市场风格股票走势的判断采取风格轮换的投资策略。在具体投资管理中可能会在股票风格划分、风格配置比例、大类资产配置比例等环节形成误判而导致基金财产损失。

10、人才流失风险

公司主要业务人员的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

11、其他风险

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

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

（二）声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

十九、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、下列涉及到《基金合同》内容变更的事项须召开基金份额持有人大会：

（1） 更换基金管理人；

（2） 更换基金托管人；

（3） 转换基金运作方式；

（4） 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（5） 变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8） 本基金与其他基金合并；

（9） 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

（10） 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

（1）因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

（2）基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；

（3）因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容作出相应变动的。

2、基金份额持有人大会决定的关于变更基金合同的事项自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。自生效之日起 3 日内在至少一种指定媒体及基金管理人网站公告。

（二）《基金合同》的终止

1、有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新

基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应组织清算小组对基金财产进行清算。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算组

（1）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

2、基金财产清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产按照下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）缴纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利与义务

1．1　根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）　依法募集基金；

（2）　自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）　依照《基金合同》获得基金管理费，亲自或委托其他机构向投资者收取事先公告的合理费用以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）　销售基金份额；

（5）　召集基金份额持有人大会；

（6）　依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）　在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）　选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理。如认为基金代销机构违反本《基金合同》、基金销售代理协议及国家有关法律规定，基金管理人应行使法律法规、本《基金合同》或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益；

（9）　依据本《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（10）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（11）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（12）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13） 在法律法规允许的前提下依法为基金进行融资；

（14） 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15） 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（16） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

1．2 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1） 办理基金备案手续；

（2） 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（3） 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（4） 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（5） 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6） 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7） 依法接受基金托管人的监督；

（8） 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9） 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10） 编制基金季度、半年度和年度报告；

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

（12） 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13） 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（14） 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15） 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16） 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、和其他相关资料 15 年以上；

（17） 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18） 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19） 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20） 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21） 基金托管人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

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

（23） 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并在基金募集期限结束后 30 天内返还投资人已缴纳的款项并加计银行同期存款利息；

（24） 执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25） 不从事任何有损基金财产及其他基金当事人利益的活动；

（26） 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（27） 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

2、基金托管人的权利与义务

2．1 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1） 自本基金合同生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2） 依《基金合同》约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

（3） 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4） 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

（5） 以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立资金结算账户，用于证券交易资金清算；

（6） 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金的债券及资金的清算；

（7） 按照规定召集基金份额持有人大会；

（8） 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2．2 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1） 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；

（2） 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

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

（4） 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金资产

为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5） 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6） 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7） 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8） 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9） 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10） 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11） 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（12） 建立并保存基金份额持有人名册；

（13） 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15） 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（16） 按照规定监督基金管理人的投资运作；

（17） 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18） 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（19） 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20） 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人的利益向基金管理人追偿；

（21） 执行生效的基金份额持有人大会决议；

（22） 不从事任何有损基金财产及其他基金当事人利益的活动；

（23） 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

3．1 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1） 分享基金财产收益；

（2） 参与分配清算后的剩余基金财产；

（3） 依法申请赎回其持有的基金份额；

（4） 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

（5） 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6） 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7） 监督基金管理人的投资运作；

（8） 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

3．2 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1） 遵守法律法规、《基金合同》及其他有关规定；

（2） 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（3） 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（4） 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；

（5） 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

（6） 执行生效的基金份额持有人大会决议；

（7） 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、召开事由

1．1　当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）变更基金投资目标、范围或策略；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（11）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

1．2　以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）调低本基金的申购费率、赎回费率或在《基金合同》规定的范围内变更收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

（1）除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

（2）基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

（5）如在上述第（4）条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

3．1　召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（4）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；

（5）代理投票授权委托书内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（6）会务常设联系人姓名及联系电话。

3．2　采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

4．1　现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

4．2　通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见。基金托管人或基金管理人经通知，拒不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有

人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、议事内容与程序

5．1　议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人

可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延，并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

5．2　议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二天在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）和公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外

的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

7、计票

7．1　现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

7．2　通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计

票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

基金管理人或基金托管人拒不派代表监督计票的，不影响计票的过程及计票结果的有效性。但基金管理人或托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

8、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 3 日内在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。如果采用通讯方式进行表决，那么在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（三）《基金合同》的变更与终止

1、《基金合同》的变更

1．1 下列涉及到《基金合同》内容变更的事项须召开基金份额持有人大会：

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）转换基金运作方式；

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8）本基金与其他基金合并；

（9）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

（10）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

1）相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

2）基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；

3）因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容作出相应变动的。

1．2　基金份额持有人大会决定的关于变更基金合同的事项自中国证监会依法核准或出具无异议意见之日起生效。自生效之日 起 3 日内在至少一种指定媒体及基金管理人网站公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止时，基金管理人应予组织清算小组对基金财产进行清算。

（四）争议的解决

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

本基金合同受中国法律管辖。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金的基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所和营业场所，投资者可在营业时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十一、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：长信基金管理有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 16 楼

办公地址：上海市黄浦区汉口路 130 号 3－4 楼

邮政编码：200002

法定代表人：田丹

批准成立时间：2003 年 4 月 28 日

批准设立文号：证监基金字[2003]63 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其他业务

2、基金托管人

基金托管人名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：经叔平

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务资格批准机关：中国证券监督管理委员会

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号

组织形式：股份有限公司（上市公司）

注册资本：2,586,721,300 元人民币

存续期间：永久存续

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办

理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。本行经中国人民银行批准，可以经营结汇、售汇业务。（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

长信增利动态策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行并上市的股票(含新股配售与增发)、权证、债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

本基金的投资组合将遵循以下限制：

A、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

B、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

C、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

D、本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

E、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

F、本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产

净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定。

G、本基金投资资产支持证券的，本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外。

H、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

I、本基金资产投资于股票类资产的比例范围是 60%—95%；投资于债券类资产的比例范围是 0%—35%；投资于货币市场工具的比例范围是 5%—40%（其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)-(3)项以及(5)-(8)项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（3）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本协议第十五条基金投资禁止行为进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。

（4）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场

的交易规则进行交易。

（5）在基金投资银行存款前，基金管理人确定符合条件的所有存款银行名单，并及时提供给基金托管人。当基金管理人确定的存款银行名单发生变化时，基金管理人应当及时书面通知基金托管人。基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资银行存款的交易对手范围是否符合有关规定进行监督。同时基金托管人应和基金管理人签订协议，明确对基金投资银行存款业务的其他监督事项。

（6）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（7）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在违反法律法规、《基金合同》、本托管协议的行为，应当及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对、确认并以书面形式向基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正，并予协助配合。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，严重损害基金份额持有人利益的，应立即报告中国证监会，同时以书面形式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照托管协议对基金业务执行监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效核查，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

2、基金管理人对基金托管人的业务监督和核查

（1）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（2）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日结束前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（3）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（三）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；

（2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产；

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他财产实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立；

（5）除依据法律法规规定和《基金合同》约定外，基金托管人不为自己及任

何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产；

（6）对于基金（认）申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日没有到达基金托管人处的基金认（申）购款项，基金托管人应及时通知基金管理人，由基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿；

（7）对于由于基金投资产生的应收资产，由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行处理，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿；

（8）除依据法律法规规定和《基金合同》约定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金募集资金的验证和入账

（1）基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期限届满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关基金备案条件的规定时，在自基金募集结束的十个工作日内，基金管理人将属于本基金的财产从基金募集专户划入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，并聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，基金管理人自收到验资报告之日起十日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续，并予以公告。验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

（3）若基金募集期限届满，未能达到基金备案条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金有关的银行账户的开设和管理，基金管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

（2）基金托管人以本基金名义在其营业机构开设基金托管专户，存放基金的

银行存款。基金托管专户由基金托管人负责开设和管理。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、收取申购款，均需通过基金的托管专户进行。

（3）基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其他有关规定。

4、基金证券账户、基金托管人证券交易资金结算账户的开设和管理

（1）按照中国证券登记结算有限责任公司关于账户管理的有关规定，基金托管人将以基金托管人与本基金联名的形式在其上海、深圳分公司为基金分别开立证券账户，用于本基金在上海、深圳证券交易所进行证券投资的登记和存管。证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

（2）证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

（3）按照中国证券登记结算有限责任公司关于账户管理和资金结算的有关规定，基金托管人以其自身名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司分别开立有关投资交易资金结算备付金和结算保证金账户等，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部受托财产在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

基金管理人应配合托管人，按照中国证券登记结算有限责任公司业务管理的规章制度、业务规则等提供基金开户所需的相关资料，同时应配合基金托管人缴足相关结算业务费用、互保基金、最低备付金、保证金等。

5、债券托管账户的开立和管理

（1）《基金合同》生效后，由基金管理人负责以基金的名义申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限

责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券和资金的结算，基金管理人应当予以配合并提供相关资料。

（2）基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间国债市场回购主协议等相关法律文件，基金托管人保管协议正本，基金管理人保存协议副本。

6、其他账户的开立和管理

（1）因业务需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定,经由基金管理人和基金托管人协商同意,由基金托管人负责开立。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券、银行存款定期存单等有价凭证可以存放于基金托管人的保管库，但要与存放于基金托管人处的非本基金的其他实物证券等有价凭证分开保管。实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司或其他由基金托管人选定的代保管库中，保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

（1）与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处，保管期限按照国家有关规定执行。

（2）与基金财产有关的重大合同，根据基金运作管理的需要由基金托管人以基金的名义签署的，基金管理人应及时通知基金托管人。合同原件由基金托管人保管，但基金托管人应将该合同原件的复印件加盖基金托管人公章（骑缝章）后，交基金管理人一份。如该等合同需要加盖基金管理人公章，则基金管理人至少应保留一份合同原件。保管期限按照国家有关规定执行。

（3）因基金管理人将自己保管的本基金重大合同在未经基金托管人同意的情

况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金财产损失，由基金管理人负责，基金托管人可以免责。

因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经基金管理人同意的情况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金财产损失，由基金托管人负责，基金管理人可以免责。

（四）基金财产净值计算与复核

1、本基金应按照相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法进行估值，如该方法不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

2、基金管理人和基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应及时改正，并报告中国证监会。对基金或基金份额持有人造成损害的，按各自应承担的责任对基金或基金份额持有人进行赔偿。

3、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

（1）差错类型

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

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

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

（2）差错处理原则

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

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

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

D、差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

E、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

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

G、按法律法规规定的其他原则处理差错。

（3）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

B、根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

C、根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（4）基金份额净值差错处理的原则和方法

A、当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

B、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1）本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

3）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金

管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

4）由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

C、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

D、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

4、基金资产净值、基金份额净值的计算、复核的时间及程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、基金份额净值等估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后，加盖业务公章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公告。

5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（1）基金账册的建立和核对

基金托管人和基金管理人在《基金合同》生效后，应按照《基金合同》中约定的记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，切实保证基金财产的安全。

经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值及基金收益情况的计算和公告的，以基金管理人的账册为准，并由差错方承担由此而产生的责任。

（2）基金财务报表与报告的编制和复核

A、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人按规定分别独立编制。

B、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人业务公章，各留存一份。

C、财务报表与报告的编制与复核时间安排

1）月度报表的编制，应于每月结束后 5 个工作日内完成。基金管理人应在每月结束之日起 2 个工作日内完成月度报表编制，加盖业务公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在收到之日起 2 个工作日内完成复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

2）基金季度报告在每个季度结束之日起 15 个工作日内公告。基金管理人应在每季度结束之日起 8 个工作日内完成季度报表编制，加盖业务公章后，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在 5 个工作日内完成复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。

3）半年度报告在基金会计年度前六个月结束后 60 日内公告。基金管理人应在上半年结束之日起 30 日内完成半年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

4）年度报告在基金会计年度结束后 90 日内公告。基金管理人在每年结束之日起 50 日内完成年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

5）基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表、文件达成一致，按照基金管理人编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

6）基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

7）在基金的存续期内，如果中国证监会就基金财务报表与报告的编制规则及编制内容颁布新的法律法规，基金管理人、基金托管人应依照届时有效的法律法规，互相配合、互相监督，进行编制和披露。

（五）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金份额的登记由基金注册登记机构负责。本基金注册登记机构由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构担任。基金注册登记机构应妥善保管基金份额持有人的全部信息资料，并编制基金份额持有人名册，定期发送基金托管人。

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称、持有的基金份额以及基金管理人、基金托管人为履行有关法律法规、《基金合同》规定的职责之目的所需内容。

基金注册登记机构应当及时向基金托管人提供《基金合同》生效日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册。基金注册登记机构应当自上述日期之日起五个交易日内，以电子传输数据文件形式或者双方同意的其他方式将上述日期的基金份额持有人名册送达托管人保存。为基金托管人履行有关法律法规、《基金合同》规定的职责之目的，基金管理人应当提供任何必要的协助。

基金托管人应当根据有关法律法规的规定妥善保管基金注册登记机构发送的基金份额持有人名册，对基金份额持有人名册的相关信息负有保密义务。基金托管人因无法妥善保管基金份额持有人名册而对投资者或基金带来损失的，应当承担相应的赔偿责任。

基金份额持有人名册至少保存 15 年以上。

（六）争议解决方式

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应先友好协商解决。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，由中国国际经济贸易仲裁委员会按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（七）托管协议的修改与终止

1、本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或被依法取消基金托管资格或因其他事由造成基金托管人更换；

（3）基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或被依法取消基金管理资格或因其他事由造成基金管理人更换；

（4）发生《基金法》、其他法律法规或《基金合同》规定的其他终止事项。

二十二、基金份额持有人服务

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

基金份额持有人服务内容			
序号	**类型**	**明细**	**内容详述**
（一）	**账户服务**	对账单服务	每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 15 个工作日内，基金管理人向本月发生的新开户并进行基金交易的投资者以书面或电子形式寄送交易对账单； 每一年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本年度内所有持有本基金基金份额的投资者，或在本年内有交易、基金份额余额为零的投资者以书面或电子形式寄送年度交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。
（二）	**查询服务**	网络在线查询	客户通过基金账户号码或开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站“账户查询”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改、在线咨询等多项在线服务。
		交易信息查询	在一笔交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“账户查询”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。
		客户账户信息的修改	基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。 为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下： 1、代销客户由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。可以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能够修改其中一项关键信息。 2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件以及开放式基金账户业务申请表；正常变更只需要提供身份证复印件和开放式基金账户业务申请表，邮寄到公司。
（三）	**基金投资的服务**	网上交易	投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。

		定期定额投资计划	通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。
		定期不定额投资计划	通过定期不定额投资计划，投资者可以通过本公司“长金通”网上直销平台提交交易申请，约定“基金品种”、“每月扣款日期”、“基准金额”、“标的指数”、“均线种类”、“级差”等参数，用指定的计算方法计算出投资金额，委托本公司完成交易的一种基金投资方式。
		红利再投资	本基金收益分配时，经投资者选择，基金管理人将为持有人提供红利再投资服务，其分红资金按除息日的基金份额净值自动转成相应的基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时（权益登记日申请设置的分红方式对当次分红无效）选择更改基金分红方式。
（四）	**客户服务中心电话服务**		客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。 客户服务中心人工坐席提供每周 5 天的坐席服务,投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。
（五）	**客户投诉受理服务**	客户投诉处理流程	本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理,指定专人负责，设定专门的投诉管理工作流程，并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。
		客户投诉方式	投资者可通过本公司的客户服务专线（400-700-5566）、代销机构、公司网站（www.cxfund.com.cn）、电子邮件(service@cxfund.com.cn)、信件、传真(021-61009800-1000/1001)、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档，通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档，本公司将采取适当措施，及时妥善处理客户投诉，总结相关问题，完善内控制度。
（六）	**增值服务**	信息定制服务	基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息，包括产品净值、交易确认、分红公告、公司新闻、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求，将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息，
		个性化理财服务	随着公司的发展，本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务，如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。
		组织投资者交流会	本公司将不定期地举行投资者交流会，为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座，使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外，本公司基金经理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流，让基金份额持有人了解更多基金运作情况。
（七）	**投资**	投资者教育	为了进一步做好投资者服务，让投资者了解证券市场和各类证

	者教育服务	活动	券投资品种的特点和风险，熟悉证券市场的法律法规，树立正确的投资理念，增强风险防范意识，依法维护自身合法权益，本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。
（八）	**公开信息披露服务**	披露公司信息	本公司将按规定在中国证监会指定的信息披露媒体上披露法定的文件、公告信息。 本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金宣传资料来披露本基金相关信息，包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。
		披露基金信息	为方便社会公众了解公司的信息，包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息，本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566（免长话费）和公司网站（www.cxfund.com.cn），以方便投资者查询。
		其他信息的披露	本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外，还提供其他信息咨询，包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。
（九）	**客户服务联络方式**	客户服务专线	4007005566（免长话费）、工作时间（8：30-17：00）内可转人工座席。
		传真	021-61009800-1000/1001
		公司网址	http://www.cxfund.com.cn
		电子信箱	service@cxfund.com.cn
		对账单服务	每次交易结束后，投资者可在 T＋2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 15 个工作日内，基金管理人向本月发生的新开户并进行基金交易的投资者以书面或电子形式寄送交易对账单； 每一年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本年度内所有持有本基金基金份额的投资者，或在本年内有交易、基金份额余额为零的投资者以书面或电子形式寄送年度交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。

二十三、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-5-31
2	长信基金管理有限责任公司关于开通多交易账户业务的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-6-10
3	长信基金管理有限责任公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-6-13
4	长信基金管理有限责任公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-6-18
5	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	中证报、上证报、证券时报	2011-6-21
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告	中证报、上证报、证券时报	2011-6-22
7	长信增利动态策略股票型证券投资基金更新的招募说明书及摘要 2011年第【1】号	上证报、证券时报	2011-6-23
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券日报	2011-6-28
9	长信基金管理有限责任公司关于增加深圳发展银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-7-1
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2011年6月30日资产净值的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-7-1
11	长信基金管理有限责任公司关于增加杭州银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报	2011-7-6
12	长信增利动态策略股票型证券投资基金2011年第二季度报告	上证报、证券时报	2011-7-19

13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加长江证券股份有限公司基金网上交易及手机证券交易申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2011-8-5
14	长信增利动态策略股票型证券投资基金 2011 年半年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报	2011-8-27
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加华宝证券有限责任公司基金网上申购和定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2011-8-30
16	长信基金管理有限责任公司关于增加重庆银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-9-10
17	长信增利动态策略股票型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	上证报、证券时报	2011-10-26
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加华安证券有限责任公司基金网上申购和定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2011-11-4
本信息披露事项截止时间为 2011 年 11 月 9 日			

二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十五、备查文件

本基金备查文件包括：

（一）中国证监会批准长信增利动态策略股票型证券投资基金募集的文件；

（二）《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》；

（三）《长信增利动态策略股票型证券投资基金托管协议》；

（四）法律意见书；

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（七）基金销售代理人业务资格批件和营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

2011 年 12 月 23 日