长信可转债债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:深圳发展银行股份有限公司

二〇一二年二月

重要提示

长信可转债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2012年1月4日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】6号文核准募集。

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

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

一、绪 言

《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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《长信可转债债券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可转债债券型证券投资基金的投资目标、投资理念、投资策略、风险、费率等与投资者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。本招募说明书由本基金管理人解释。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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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,除非文意另有所指,下列词语或简称代表如下含义:

释 义	
基金或本基金	指长信可转债债券型证券投资基金
基金管理人或本基金管理人	指长信基金管理有限责任公司
基金托管人或本基金托管人	指深圳发展银行股份有限公司
基金合同	指《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长信可转债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
招募说明书	指《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
发售公告	指《长信可转债债券型证券投资基金基金份额发售公告》
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
《基金法》	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
《销售办法》	指中国证监会2010年10月25日修订,2011年10月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订
《信息披露办法》	指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订
《运作办法》	指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订
中国	指中华人民共和国,就基金合同而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构	指中国人民银行和或中国银行业监督管理委员会
基金合同当事人	指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
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境内合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织机构
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办法》及其他相关法律法规规定的条件,经中国证监会批准可投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者
基金投资者	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
基金份额持有人	指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者
基金销售业务	指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构	指直销机构和代销机构
直销机构	指长信基金管理有限责任公司
代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构
基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司或接受长信基金管理有限责任公司委托代为办理注册登记业务的机构
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
基金合同生效日	指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并收到其书面确认的日期
基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期
基金募集期限	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T日	指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回或其他基金业务申请的工作日
T+n日	指自T日起第n个工作日(不包含T日)
开放日	指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
交易时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
《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》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则,由基金管理人和基金投资者共同遵守
认购	指在基金募集期间,基金投资者申请购买基金份额的行为
申购	指在基金存续期内,基金投资者申请购买基金份额的行为
赎回	指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人将其持有的基金份额兑换成现金的行为
巨额赎回	本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额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)超过上一开放日基金总份额的10%的情形
基金转换	指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金份额间的转换行为
转托管	指基金份额持有人将其持有的同一基金账户下的基金份额全部或部分从一交易账户转移到另一交易账户的行为
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
元	指人民币元
基金收益	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额
基金资产总值	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的净资产值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值
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和基金份额净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、基金管理人、基金托管人的互联网网站及其他媒体
可转换债券	指可转换公司债券(包括可分离交易的可转换公司债券),简称可转债,是依照法定程序发行、在一定期间内依据约定的条件可以转换为股份的公司债券
不可抗力	指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服,且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之后发生的,使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件,包括但不限于战水、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成员情况

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。曾任步长273团政治处主任,步长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;上海交大南洋商厂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、中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,武汉大学珞珈成市信用社副董事长,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(每)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	金融学硕士,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.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	基金经理	自基金合同生效之日起	工学硕士,华南理工大学管理工程研究生毕业,具有基金从业资格,加拿大特许投资经理资格(CIM)。曾任长城证券公司证券分析师,加拿大Investors Group Financial Services Co.Ltd投资经理和投资顾问。2002年10月加入长信基金管理有限责任公司(筹备),先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监。现任固定收益部总监、长信中短债证券投资基金的基金经理和长信利丰债券型证券投资基金的基金经理。
刘波	基金经理	自基金合同生效之日起	经济学硕士,上海财经大学国际经济专业研究生毕业,具有基金从业资格。曾任太平洋养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011年3月加入长信基金管理有限责任公司,现任固定收益部基金经理助理。

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
李洪书	交易管理部副总监
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	107人(截至2012年2月)

(下转D18版)

长信可转债债券型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:深圳发展银行股份有限公司

客户服务专线:400-700-5566

重要提示

1.长信可转债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证券监督管理委员会证监许可【2012】6号文核准。

2.本基金是契约型开放式债券型证券投资基金。

3.本基金的管理人为长信基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”),托管人为深圳发展银行股份有限公司(以下简称“深圳发展银行”),本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)。

4.本基金将自2012年2月27日起至2012年3月20日止通过基金管理人指定的销售机构(包括直销和代销机构)公开发售。

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,通过本公司网上直销系统办理开户、认购等业务。(目前本公司仅对个人投资者开通网上交易服务)

5.本基金不设首次募集规模上限。

6.本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

7.投资者认购本基金,需使用上海证券交易所普通股票账户(或证券投资基金账户)开立为申登开放式基金账户,没有上海证券交易所普通股票账户(或证券投资基金账户)的投资者,可通过销售机构申请注册开放式基金账户。

8.投资者在申请开立基金账户时应指定一个银行账户为其结算账户(或称“资金交收账户”),用于该投资者的基金赎回、分红和退款等资金结算。该账户的户名应与投资者开立的基金账户名称相同。

9.销售机构(本公告中如无特别指明,销售机构即指直销机构和各代销机构),对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表确实接受了认购申请。申请的成功与否应以基金管理人通过基金注册登记机构发送的确认结果为准。投资者可在基金合同生效后到原认购网点或通过本公司网站查询最终成交确认情况和认购的份额。

10.本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请阅读2012年2月22日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》。

11.本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.cxfund.com.cn),投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解基金募集相关事宜。

12.关于代销机构的代销网点、联系方式以及开户和认购等具体事项,请向各代销机构咨询。

13.本基金份额发售期内,除本公司所列的代销机构外,如增加其他代销机构,本公司将及时公告,请留意本公司及各代销机构的公告或按打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

14.投资者所在地若未开设销售网点,请按打本公司的直销专线电话021-61009916或客户服务专线4007005566(免长话费)咨询认购事宜。

15.本公司可综合各种情况对本基金份额发售事宜做适当调整。

16.风险提示:

证券投资基金是一种利益共享、风险共担的集合证券投资方式。基金投资者依其所持有基金份额享受基金投资的收益,同时承担基金投资亏损的风险。基金不同于银行储蓄和债券,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

本基金投资于证券市场,在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,也包括基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、技术风险、合规风险和本基金的特定风险等。还包括由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时,投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额,此外,本基金以1.00元初始面值进行份额发售,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1.00元初始面值的风险。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人提示投资者应全面认识、充分了解本基金产品的风险收益特征,根据自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”的原则,在作出投资决策后,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。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

一、基金募集的基本情况

(一)基金名称和基金代码

长信可转债债券型证券投资基金

基金简称:长信可转债债券

基金代码:519977(A类);519976(C类)

场内认购代码:521977(A类);521976(C类)

(二)基金的类别

债券型证券投资基金

(三)基金的运作方式

契约型开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额面值

本基金份额初始面值为人民币1.00元

(六)基金份额类别

本基金根据认购、申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购和赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类和C类基金份额分别计算基金份额净值。计算公式为:计算日某类别基金份额净值=计算日该类别基金份额资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同份额类别之间一经认购、申购,不得相互转换。

本基金有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定,并在招募说明书中列示。

(七)发售对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

(八)销售机构

1.直销机构:长信基金管理有限责任公司直销中心,投资者还可通过本公司网上直销系统认购本基金。

2.代销机构:深圳发展银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、中航证券有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、天风证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、天源证券经纪有限公司、西藏同信证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中山证券有限责任公司以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售服务业务的有资格的上证所会员。

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。

(九)募集时间安排与基金合同生效

根据有关法律法规的规定,本基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金的募集时间为2012年2月27日至2012年3月20日止,期间面向个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者等同时发售。基金管理人可视情况提前结束募集,并将及时公告。

募集期满,且具备基金备案条件的,本基金管理人将根据有关规定办理基金备案手续,自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效,本基金管理人将在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

若3个月的募集期满,本基金的基金合同仍未达到基金合同规定的生效条件,本基金管理人将采担因募集行为而产生的债务和费用,并在基金募集期限届满后三十日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

(十)基金认购方式与费率

1.认购方式

本基金采用金额认购方式,投资者可以通过当面委托、传真委托、网上交易等方式进行认购。

2.认购费率

本基金A类基金份额在投资者认购时收取认购费;C类基金份额在认购时不收取认购费,但从C类基金资产中计提销售服务费,销售服务费的费率为年费率0.35%。本基金A类基金份额的认购费率随认购金额的增加而递减。募集期投资者可以多次认购本基金,认购费率按每笔认购申请单独计算。

本基金认购费率如下表:

基金份额类别	单笔认购金额(M,含认购费)	认购费率
A类基金份额	M<100万	0.6%
	100万≤M<300万	0.4%
	300万≤M<500万	0.2%
	M≥500万	每笔1000元
C类基金份额	0	

注:M为投资金额

认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

3.认购份额的计算

①A类基金认购份额的计算

若投资者选择认购A类基金份额,则认购份额的计算公式为:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

或,净认购金额=认购金额-固定认购费金额

认购费用=认购金额-净认购金额,或,固定认购费金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额发售面值

场外认购份额的计算结果保留小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额保留到整数位,不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位返还给投资者。

例一:某投资人在认购期投资10万元认购本基金A类基金份额,其对应认购费率为0.6%,认购金额在认购期间产生的利息为50元,则其可得到的认购份额计算如下:

净认购金额=100,000/(1+0.6%)=99,403.58元

认购费用=100,000-99,403.58=596.42元

场外认购份额=(99,403.58+50)/1.00=99,453.58份

场内认购份额=(99,403.58+50)/1.00=99,453份

②C类基金认购份额的计算

若投资者选择认购C类基金份额,则认购份额的计算公式为:

认购份额=(认购金额+认购利息)/基金份额发售面值

例二:某投资人在认购期投资10万元认购本基金C类基金份额,认购金额在认购期间产生的利息为50元,则其可得到的认购份额计算如下:

场外认购份额=(100,000+50)/1.00=100,050份

场内认购份额=(100,000+50)/1.00=100,050份

场外认购份额的计算结果保留小数点后两位,小数点后两位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额保留到整数位,不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位返还给投资者。

4.首次募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购资金在募集期间产生的利息以注册登记机构的记录为准,在募集期结束后归入投资者认购金额中,如基金合同生效,则折算为基金份额注投资者所有。

二、募集方式及相关规定

(一)本次基金的募集,在募集期内将面向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者同时公开发售。基金募集期间不设置投资者单个账户最高认购金额限制。

(二)场内认购须遵守上海证券交易所相关规则。通过场内代销机构认购本基金时,每笔最低认购金额为1,000元人民币且必须是100元的整数倍,单笔认购最高不超过99,999,900元人民币。

(三)通过本基金直销机构首次认购本基金的单笔最低金额(含认购费)为10万元,追加认购的最低金额为1,000元,不设金额级差。

(四)本公司网上直销系统可接受个人投资者单笔认购金额在1000元人民币以上(含1000元)的认购申请。具体认购限额以投资者指定结算机构的规定为准。

(五)代销机构的代销网点接受投资人每次认购本基金的最低金额为1,000元(含认购费),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。

(六)投资者在募集期内可多次认购本基金。认购申请一经销售机构受理,即不得撤销。

(七)本基金不设募集上限。

三、个人投资者的开户与认购程序

(一)直销机构

1.直销中心

个人投资者如果认购金额在10万元(含10万元)人民币以上的,可到直销中心办理认购。

①业务办理时间

基金募集期间每日上午9:00至下午16:30(周六、周日及法定节假日不受理)。

②开立基金账户

个人投资者申请开立开放式基金账户,应提交下列材料:

1)填妥的《开放式基金账户业务申请表》;

2)本人有效身份证件原件及复印件(二代身份证正反面复印);

3)上海人民币普通股票账户卡或证券投资基金账户卡(非必备材料。若有请提供,可直接开立为开放式基金账户);

4)资金结算账户的原件及复印件;

5)开通传真交易的投资者,签署《开放式基金交易传真交易协议》;

6)填写投资人风险承受能力调查表;

7)本公司需要提交的其他材料。

③提出认购申请

个人投资者办理认购申请需准备以下资料:

1)填妥的《开放式基金交易业务申请表》;

2)本人有效身份证件原件及复印件(二代身份证正反面复印)。

④认购资金的缴纳

1)个人投资者应在提出认购申请当日下午16:30之前,将足够认购资金划至本公司在银行开立的直销专户。

表1:本公司直销账户列表

直销账户一:中国农业银行	
户 名:	长信基金管理有限责任公司(直销专户)
开 户 行:	中国农业银行上海卢湾支行
账 号:	03492300040003423
联行行号:	30398
直销账户二:中国建设银行	
户 名:	长信基金管理有限责任公司
开 户 行:	中国建设银行上海市浦东分行营业部
账 号:	31001520313050002399
联行行号:	52440
人行大额支付系统行号:	105290061008
直销账户三:中国银行	
户 名:	长信基金管理有限责任公司
开 户 行:	中国银行上海市浦东分行
账 号:	445559213730
联行行号:	40358
人行大额支付系统行号:	104290003582
直销账户四:中国工商银行	
户 名:	长信基金管理有限责任公司
开 户 行:	中国工商银行上海市分行营业部
账 号:	1001202919025804062