长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2015年第【1】号

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称:"本基金")由基金管理人根据中国证券监督管理委员会证监许可【2008】357号文核准募集。本基金基金合同于2008年6月19日正式生效。本基金为混合型契约开放式基金。

重要提示

本基金经2008年3月7日中国证券监督管理委员会证监许可【2008】357号文核准募集。本基金基金合同于2008年6月19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,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,投资人认购(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,充分考虑投资人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人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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。本基金属于灵活配置混合型证券投资基金,股票类资产的投资范围为30%至80%。在基金投资管理运作过程中,基金管理人进行灵活、主动进行资产配置时,可能会出现因基金管理人主观上的因素(如对市场判断失误等)造成的风险。基金管理人提请投资人注意,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,由投资人自行负责。

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。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为2014年12月19日,有关财务数据和净值截止日为2014年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国农业银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	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	魏明东		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务,发起设立基金,中国证监会批准的其他业务(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,硕士研究生学历,EMBA。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七届监事会监事。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、总裁,长江证券股份有限公司第六届监事会监事长。
杨泽柱	董事	男	中共党员,博士研究生,现任湖北省人大常务委员会委员、长江证券股份有限公司党委书记、董事长。曾任湖北省松滋县老城公社党委副书记、书记,松滋县检察院检察长,松滋县政府常务副县长、县委常委,巴东县政府县长、县委副书记,荆州地区(荆沙市)计委主任、党组副书记,荆沙市副市长,荆州市委常委、副市长、市行政学院院长,荆门市委副书记、副市长、市行政学院院长,荆门高新技术开发区党委第一书记,湖北省委台湾工作办公室、湖北省政府台湾事务办公室主任,湖北省国资委主任、党委书记,湖北省联合发展投资集团有限公司党委书记。
陈谋亮	董事	男	中共党员,法学硕士,工商管理博士,高级经济师,高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。曾任湖北省委组织部"第三梯队干部班"干部,中国第二汽车制造厂干部,湖北经济学院讲师、特聘教授,扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问,中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表,交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表,海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁。
彭辰	董事	男	中共党员,博士研究生学历,经济学博士,正高职高级会计师,研究员。现任武汉钢铁(集团)公司党委常委、副总经理,武汉钢铁股份有限公司董事会董事。曾任武汉钢铁(集团)公司副总经理兼总会计师、党委常委,武汉钢铁股份有限公司总经理。
蒋学杰	董事	男	经济学硕士,澳大利亚墨尔本大学商学院MBA。现任长信基金管理有限责任公司总经理。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。
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。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、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。
宋晓燕	独立董事	女	中共党员,法学博士,律师。现任上海财经大学法学院教授。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。
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。现任武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长。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。
陈水元	监事	男	硕士研究生,会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理,长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理,长江证券股份有限公司营业部总经理总裁特别助理。
杨爱民	监事	男	中共党员,在职研究生学历,会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长,甘肃省铝业公司财务处副处长、处长,上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员,硕士。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部负责人。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。
孙红辉	监事	男	中共党员,硕士。现任长信基金管理有限责任公司基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员,硕士。现任长信基金管理有限责任公司人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。
注:上述人员之间均不存在近亲属关系			

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
蒋学杰	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士,EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理,长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理,长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
宋小龙	副总经理	男	理学硕士,北京大学计算机软件专业研究生毕业,具有基金从业资格。2012年10月加入长信基金管理有限责任公司,现任长信基金管理有限责任公司副总经理,兼任长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
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
谈洁颖	基金经理	2012年7月24日至今	管理学学士,中国人民大学工商企业管理专业本科毕业,具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司投资管理部副总监、长信双利优选灵活配置证券投资基金的基金经理。曾就职于北京大学,从事教育管理工作;2004年8月加入长信基金管理有限责任公司,历任研究助理、基金经理助理、专户理财投资经理。
钱斌	基金经理	2010年7月21日至2012年8月4日	曾任本基金的基金经理。
胡志宝	基金经理	2008年6月19日至2010年8月26日	曾任本基金的基金经理。
张甦伟	基金经理	2008年7月25日至2010年7月5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
宋小龙	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
胡志宝	公司投资总监、投资决策委员会执行委员、长信增利动态策略股票型证券投资基金的基金经理
安昀	研究发展部总监、长信内需成长股票型证券投资基金的基金经理、长信银利精选开放式证券投资基金的基金经理、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
姚飞军	交易管理部总监
李小羽	总经理助理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金的基金经理、长信可转债债券型证券投资基金的基金经理、长信纯债一年定期开放债券型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、零售服务部、机构业务部、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	117人(截至2014年12月19日)		
员工学历构成	学历	人数	占比
	博士	1人	1%
	硕士	66人	56%
	本科	44人	38%
	专科	4人	3%
	其他	2人	2%
	总计	117人	100%

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:刘士余

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】23号

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68121510

传真:010-68121816

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2014年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共227只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商招利1个月期理财债券型证券投资基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、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:朱俊
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)中国邮政储蓄银行股份有限公司	
注册地址:北京市西城区金融大街3号	
办公地址:北京市西城区金融大街3号	
法定代表人:李国华	联系人:文彦娜
传真:010-68858117	网址:www.psbc.com
客户服务电话:95580	
(2)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:蒋超良	联系人:张凯学
传真:010-85109219	
客户服务电话:95599	网址:www.abchina.com
(3)中国工商银行股份有限公司	
注册地址:中国北京复兴门内大街55号	
办公地址:中国北京复兴门内大街55号	
法定代表人:姜建清	联系人:查樱
客户服务电话:95588	网址:www.icbc.com.cn
(4)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:田国立	联系人:宋亚平
客户服务电话:95566	网址:www.boc.cn
(5)中国建设银行股份有限公司	
注册地址:北京市西城区金融大街25号	
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
法定代表人:王洪章	联系人:张静
电话:010-67596084	
(6)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:牛锡明	联系人:张作伟
电话:021-58781234	传真:021-58408483
客户服务电话:95559	网址:www.bankcomm.com
(7)招商银行股份有限公司	
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
法定代表人:李建红	联系人:曾里南
电话:0755-83198888	传真:0755-83195109
客户服务电话:95555	网址:www.cmbchina.com
(8)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:唐苑
电话:021-61618888	传真:021-63604199
客户服务电话:95528	网址:www.spdb.com.cn
(9)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:蒋怡
电话:0591-87839338	传真:0591-87841932
客户服务电话:95561	网址:www.cib.com.cn
(10)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:姚建英
电话:010-58560666	传真:010-57092611
客户服务电话:95568	网址:www.cmbc.com.cn
(11)中信银行股份有限公司	
注册地址:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
办公地址:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
法定代表人:常振明	
电话:010-65558888	联系人:方爽
客户服务电话:95558	公司网址:bank.ecitic.com
(12)华夏银行股份有限公司	
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦	
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦	
法定代表人:吴建	联系人:刘军祥
电话:010-85238667	传真:010-85238680
客户服务电话:010-95577	公司网址:www.hxb.com.cn
(13)汉口银行股份有限公司	
注册地址:武汉市江汉区建设大道933号武汉商业银行大厦	
办公地址:武汉市江汉区建设大道933号	
法定代表人:陈新民	联系人:李星
电话:027-82656224	传真:027-82656236
客户服务电话:(027)96558,4006096558	公司网址:www.hkbchina.com
(14)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
(15)平安银行股份有限公司	
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦	
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦	
法定代表人:孙建一	联系人:张莉
电话:0755-22166118	传真:0755-25841098
客户服务电话:95511-3	公司网址:bank.pingan.com
(16)厦门银行股份有限公司	
注册地址:福建省厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦	
办公地址:福建省厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦	
法定代表人:吴世群	联系人:林黎云
电话:0592-5365735	传真:0592-5061952
客户服务电话:400-858-8888	公司网址:www.xmbankonline.com
(17)重庆银行股份有限公司	
注册地址:重庆市渝中区邹容路153号	
办公地址:重庆市渝中区邹容路153号	
法定代表人:马千真	联系人:孔文超
电话:023-63799379	传真:023-63792412
客户服务电话:(023)63836229	网址:www.cqcbank.com
(18)安信证券股份有限公司	
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	
法定代表人:牛冠兴	联系人:陈剑虹
电话:0755-82558305	传真:0755-28558355
客户服务电话:4008-001-001	网址:www.essence.com.cn
(19)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:高峰
电话:0755-83516289	传真:0755-83515567
客户服务电话:400-6666-888	网址:www.cgws.com
(20)长江证券股份有限公司	
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦	
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦	
法定代表人:杨泽柱	联系人:李良
电话:027-65799999	传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999	网址:www.95579.com
(21)大通证券股份有限公司	
注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号	
办公地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层	
法定代表人:张智河	联系人:谢立军
电话:0411-39673202	传真:0411-39673219
客户服务电话:4008-169-169	网址:www.daton.com.cn
(22)德邦证券有限责任公司	
注册地址:上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼	
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼	
法定代表人:姚文平	联系人:王志琦
电话:021-68761616	传真:021-68767032
客户服务电话:400-8888-128	网址:www.tebon.com.cn
(23)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:沈燕
电话:021-63325888	传真:021-63326173
客户服务电话:95503	网址:www.dfzq.com.cn
(24)东莞证券有限责任公司	
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号	
办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
法定代表人:张运勇	联系人:乔芳
电话:0769-22112062	传真:0769-22119423
客户服务电话:0769-961130	网址:www.dgzq.com.cn
(25)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:陆晓
电话:0512-62936293	传真:0512-65588021
客户服务电话:400 860 1555	网址:www.dwzq.com.cn
(26)光大证券股份有限公司	
注册地址:上海市静安区新闸路1508号	
办公地址:上海市静安区新闸路1508号	
法定代表人:薛峰	联系人:刘晨
电话:021-22169999	传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788、10108998、95525	网址:www.ebscn.com
(27)华福证券有限责任公司	
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层	
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层	
法定代表人:黄金琳	联系人:张腾
电话:0591-87383623	传真:0591-87383610
客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)	网址:www.hfzq.com.cn
(28)广发证券股份有限公司	
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼	
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼	
法定代表人:孙树明	联系人: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
(29)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层10层	
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	
法定代表人:常喆	联系人:李弢
电话:010-84183389	传真:010-84183311-3389
客户服务电话:400-818-8118	网址:www.guodu.com
(30)国金证券股份有限公司	
注册地址:成都市东城根上街95号	
办公地址:成都市东城根上街95号	
法定代表人:冉云	联系人:刘一宏
电话:028-86690126	传真:028-86690126
客户服务电话:4006600109	网址:www.gjzq.com.cn
(31)国联证券股份有限公司	
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号	
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702	
法定代表人:雷建辉	联系人:沈刚
电话:0510-82831662	传真:0510-82830162
客户服务电话:95570	网址:www.glsc.com.cn
(32)国盛证券有限责任公司	
注册地址:南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)	
办公地址:南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)	
法定代表人:曾小普	联系人:陈明
电话:0791-6281061	传真:0791-6281061
客户服务电话:4008-222-111	网址:www.gsstock.com
(33)国泰君安证券股份有限公司	
注册地址: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:吴倩
电话:021-38676666	传真:021-38670666
客户服务热线:4008888666	网址:www.gtja.com
(34)国信证券股份有限公司	
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人:何如	联系人:李颖
电话:0755-82130833	传真:0755-82133952
客户服务电话:95536	网址:www.guosen.com
(35)国元证券股份有限公司	
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号	
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号	
法定代表人:凤良志	联系人:李飞
电话:05551-2615542	传真:0551-2634906
客户服务电话:955784008-888-777	网址:www.gyzq.com.cn
(36)海通证券股份有限公司	
注册地址:上海市淮海中路98号	
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦	
法定代表人:王开国	联系人:李笑鸣
电话:021-23219000	传真:021-23219100
客户服务电话:400-8888-001或95553	网址:www.htsec.com
(37)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
(38)华安证券股份有限公司	
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号	
办公地址:合肥市蜀山区南二环959号B1座华安证券	
法定代表人:李工	联系人:汪燕
电话:0551-5161666	传真:0551-5161600
客户服务电话:96518、400-80-96518	网址:www.hazq.com
(39)华宝证券有限责任公司	
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号57层	
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号57层	
法定代表人:陈林	联系人:刘闻川
电话:021-68777222	传真:021-68777822
客户服务电话:400-820-9898	网址:www.cnhbstock.com
(40)华龙证券有限责任公司	
注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦21楼	
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦	
法定代表人:李晓安	联系人:邓鹏怡
电话:0931-8784656	传真:0931-4890118
客户服务电话:4006898888	网址:www.hlzqgs.com.cn
(41)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:深圳市福田区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
(42)华泰证券股份有限公司	
注册地址:南京市中山东路90号华泰证券大厦	
办公地址:南京市中山东路90号华泰证券大厦	
法定代表人:吴万善	联系人:郭琳
电话:025-83290979	传真:025-84579763
客户服务电话:95597	网址:www.htsc.com.cn
(43)江海证券有限公司	
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
法定代表人:孙名扬	联系人:高悦铭
电话:0451-82336863	传真:0451-82287211
客户服务电话:400-666-2288	网址:www.jhzq.com.cn
(44)中航证券有限公司	
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼	
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼	
法定代表人:王宜四	联系人:戴蕾
电话:0791-86768681	传真:0791-86770178
客户服务电话:400-8866-567	网址:www.avicsec.com
(45)齐鲁证券有限公司	
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号	
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号	
法定代表人:李玮	联系人:王霖
电话:0531-68889155	传真:0531-68889752
客户服务电话:95538	网址:www.qlzq.com.cn
(46)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:许曼华
电话:021-53519888	传真:021-53519888
客户服务电话:4008918918、021-962518	网址:www.962518.com
(47)申银万国证券股份有限公司	
注册地址:上海市常熟路171号	
办公地址:上海市长乐路989号(近常熟路)世纪商贸办公大楼40楼	
法定代表人:储晓明	联系人:黄莹
电话:021-54047673	传真:021-33388212
客户服务电话:021—95523	网址:www.sywg.com.cn
(48)天风证券股份有限公司	
注册地址:中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼	
办公地址:中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼	
法定代表人:余磊	联系人:翟璟
电话:027-87618882	传真:027-87618863
客服电话:028-86711410	网址:www.tfzq.com
(49)天相投资顾问有限公司	
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层	
法定代表人:林义相	联系人:尹伶
电话:010-66045529	传真:010-66045527
客户服务电话:010-66045678	网址:www.txsec.com
(50)天源证券有限公司	
注册地址:西宁市城中区西大街11号	
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:林小明	联系人:张靓雅
电话:0755-33331188-8805	传真:0755-33329815
客户服务电话:400-65432-18	网址:www.tyzq.com.cn
(51)西藏同信证券股份有限公司	
注册地址:拉萨市北京中路101号	
办公地址:上海市永和路118弄东方企业园24号	
法定代表人:贾绍君	联系人:汪尚斌
电话:021-36533017	传真:021-36533017
客户服务电话:400-8811-177	网址:www.xzsec.com
(52)湘财证券有限责任公司	
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼	
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼	
法定代表人:林俊波	联系人:钟康莺
电话:021-68634518	传真:021-68865680
客户服务电话:400-888-1551	网址:www.xcsc.com
(53)日信证券有限责任公司	
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号	
办公地址:北京西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层	
法定代表人:孔佑杰	联系人:陈文彬
电话:010-83991743	传真:010-66412537
客户服务电话:010-83991888	网址:www.rxzq.com.cn
(54)兴业证券股份有限公司	
注册地址:福州市湖东路268号	
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大.五道口广场1号楼21层	
法定代表人:兰荣	联系人:夏中苏
电话:021-38565785	
客户服务电话:400-8888-123	网址:www.xyzq.com.cn
(55)招商证券股份有限公司	
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
法定代表人:宫少林	联系人:黄婵君
电话:0755-82960223	传真:0755-82943121
客户服务电话:95565或400-8888-111	网址:www.newone.com.cn
(56)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
(57)中国银河证券股份有限公司	
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
法定代表人:陈有安	联系人:宋明
电话:010-66568888	传真:010-66568990
客户服务电话:4008-888-888	网址:www.chinastock.com.cn
(58)中信建投证券股份有限公司	
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼	
办公地址:北京市朝阳门内大街188号	
法定代表人:王常青	联系人:张颖
电话:010-85130588	传真:010-65182261
客户服务电话:400-8888-108	网址:www.csc108.com
(59)中信证券(浙江)有限责任公司	
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层	
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层	
法定代表人:沈强	联系人:丁思聪
电话:0571-86078823	传真:0571-85783771
客户服务电话:057196598	网址:www.bigsun.com.cn
(60)中信证券股份有限公司	
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座	
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦	
法定代表人:王东明	联系人:朱甜
(61)中信证券(山东)有限责任公司	
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层(266061)	
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)	
法定代表人:杨宝林	联系人:吴忠超
电话:0532-85022326	传真:0532-85022605
客户服务电话:95548	网址:www.citicssd.com
(62)中山证券有限责任公司	
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	
法定代表人:吴永良	联系人:罗艺琳
电话:0755-83734659	传真:0755-82960582
客户服务电话:4001022011	网址:www.zszq.com.cn
(63)信达证券股份有限公司	
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
法定代表人:张志刚	联系人:鹿馨方
电话:010-63081000	传真:010-63080978
客服热线:400-1818800-1888899	网址:www.cindasc.com
(64)杭州数米基金销售有限公司	
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号	
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼	
法定代表人:陈柏青	联系人:张裕
电话:0571-28829790,021-60897869	传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123	网址:www.fund123.cn
(65)上海长量基金销售投资顾问有限公司	
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层	
法定代表人:张跃伟	联系人:马良婷
电话:021-20691832	传真:021-20691861
客户服务电话:400-089-1289	网址:www.erichfund.com
(66)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司	
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室	
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801	
法定代表人:汪静波	联系人:徐诚
电话:021-38602377	传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399	网址:www.noah-fund.com
(67)上海好买基金销售有限公司	
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室	
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室	
法定代表人:杨文斌	联系人:胡锴隽
电话:021-58870011	传真:021-68596916
客户服务电话:4007009665	网址:www.ehowbuy.com
(68)和讯信息科技有限公司	
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层	
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层	
法定代表人:王莉	联系人:吴卫东
电话:021-68419822	传真:021-68419822-8566
客户服务电话:400-920-0022	网址:www.licaike.com
(69)上海天天基金销售有限公司	
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	
法定代表人:其实	联系人:朱玉
电话:021-54509998	传真:021-64385308
客户服务电话:400-1818-188	网址:fund.eastmoney.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:

信息类别	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	金颖	廖海(负责人)	姚建华
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	崔巍	廖海、刘佳	王国蓓(石海云、陈启明为经办注册会计师)

四、基金的名称

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金通过对股票和债券等金融资产进行积极配置,并精选优质个股和券种,从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下,谋求超越比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票部分包括所有在国内依法发行的A股;债券部分包括国债、金融债、高信用等级的企业债和可转债等;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。

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

八、基金的投资策略

本基金为主动式混合型基金,以战略性资产配置(SAA)策略体系为基础决定基金资产在股票类、固定收益类等资产中的配置。将股票价值优选策略模型和修正久期控制策略模型作为个股和债券的选择依据,投资于精选的优质股票和债券,构建动态平衡的投资组合,实现基金资产超越比较基准的稳健增值。

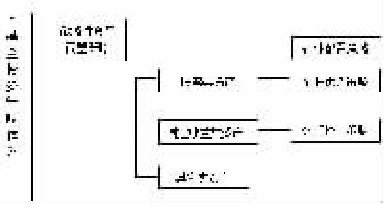

图:本基金投资策略体系

1、资产配置策略

(1)资产配置比例

本基金投资组合中,股票类资产的投资比例为基金资产的30-80%;固定收益类资产的投资比例为基金资产的15-65%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及中国证监会的规定。

当法律法规或中国证监会的相关规定变更时,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。

(2)资产配置决策流程

本基金资产配置体系依据对全球环境和国内环境的研判,通过有机结合量化分析模型和基金研究员严谨的基本面分析,确定基金资产在股票、固定收益类和其它类别资产的配置比例,在保持长期平衡的资产配置比例基础上,依据市场状况,适当的调配基金资产的配置比例,以规避或控制市场系统性风险,为投资人实现稳健增长的投资收益。

本基金资产配置的决策流程如下图所示:

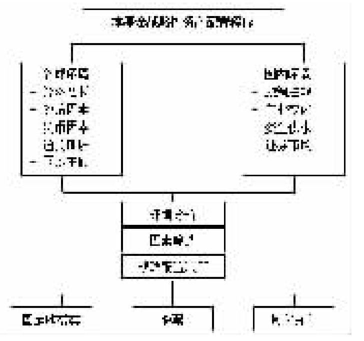

图:本基金战略性资产配置策略体系

2、股票资产投资策略

股票投资是在行业进行配置基础上,挑选具有行业投资优势并具备核心竞争力和成长力的高素质企业股票。股票资产采用双线并行的构建流程,通过行业吸引力模型和股票价值优选模型进行行业和个股的选择与配置。在行业和股票量化模型的评估过程中,本基金注重基金研究员的基本面分析,使股票资产的投资决策过程更为严谨和科学。

(1)股票类资产投资组合的构建

本基金在股票组合的构建上,运用量化的行业优选配置体系和股票价值优选模型,通过双线并行的选股体系,优选行业和行业中的个股,构建股票投资组合。

本基金股票组合构建的流程如下图所示:

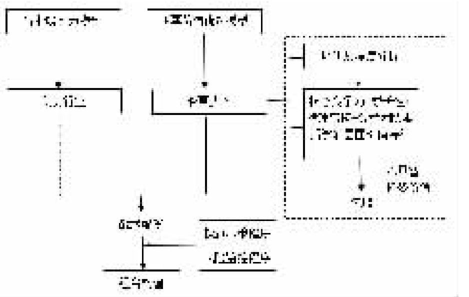

图:本基金股票组合构建流程图

股票投资组合的流程具体而言包括以下几个方面:

A、行业吸引力模型

通过本基金的行业配置体系,确定行业的轮动周期和投资价值,结合基金的投资目的,确定行业的配置比例,并根据市场动态调整行业配置比例。

B、股票价值优选模型

1)量化选股模型

股票价值优选模型是运用数量化的方法,经过客观比较,得到行业中各公司的相对价值排名。具体方法是对所有上市公司,依据中国证监会的行业分类,在每一个子行业中,按照价值优选的评价方法先对公司进行排名,再引入弹性和价格因素这两个变量,排除其中价格太高或弹性不高的公司,最后得出各公司相对的价值排名。

2)人工优化分析

通过股票价值优选模型得到各行业优质公司的排名后,通过系列调整,以排除数量分析中可能存在数据误差,并加入研究人员的专业化分析,从而精选出优质个股。投资既是一门科学也是一门艺术,本基金综合了数量化模型的科学性和专业研究团队缜密严谨的研判,以确保投资组合的有效性和投资业绩的稳健增长。

C、确定股票类资产投资组合

在精选的个股股票池中,结合本基金的投资决策程序和风险管理程序,确定个股的配置比例,构建出最终的股票投资组合。

(2)通过行业吸引力模型进行行业配置

本基金行业资产配置的核心和关键是确定行业的投资价值,挑选符合具备投资价值的行业。这里本基金采用综合评分法来预测行业的投资价值。

A、行业吸引力模型的框架

行业吸引力模型主要包括三个部分:

首先,对各个行业的投资吸引力采用综合评分法进行评估;

其次,根据各个行业的投资吸引力确定增持、中性、减持的行业,再根据投资机构或个人的风险收益偏好及流动性需求确定各行业投资吸引力排序;

再次,对资产配置的效果进行评估分析,以此修正资产配置的方法与组合。

B、综合评分:在行业投资吸引力的综合评分中,目前考虑的主要因素包括行业研究人员对各个行业的投资建议、行业估值比率、行业成长性、行业内上市公司的定价水平、行业指数的相对涨幅、行业的资产重组等因素,未来将根据资产配置的效果及市场因素的变化进行动态的修正。

表:行业评价的因素权重与评分方法

评分因素	权重(%)	评分方法
行业研究员评级	40	A:40,A-:35,B+:30,B:25,B-:15,C+:10,C:5
P/E指标	15	线性评分法
P/B指标	5	线性评分法
行业成长趋势(未来三年行业净利润水平的复合增长率)	15	线性评分法
行业平均股价	5	线性评分法
行业比较优势	15	线性评分法
重组的可能与力度	5	主观评分
合计	100	100分

(3)通过股票价值优选模型进行选股

A、股票价值优选策略

在每一个行业中,对上市公司进行价值排名,选择排名靠前并且其未来表现能够超越行业平均水平的高素质公司,这些公司的显著特征是其业绩具有持久战胜市场的能力。

B、股票价值优选模型的构建

股票价值优选模型的构建如下表所示:

表:股票价值优选模型的构建

<table>
<tr><th>步骤</th><th colspan="2">内容</th></tr>
<tr><td rowspan="2">一</td><td colspan="2">统计数据处理</td></tr>
<tr><td colspan="2">目标:给出数据处理标准和方法,得到标准化数据</td></tr>
<tr><td rowspan="2">二</td><td>公司基本价值评价(0--100)
--持续为股东创造价值的能力40%
--投资管理能力20%
--行业地位和持续经营能力10%
--毛利率10%
--管理费用比率10%
--付息债务管理能力10%</td><td>公司弹性评价(0-100)
--收入倍率60%
--在建工程弹性20%
--负债弹性20%</td></tr>
<tr><td colspan="2">目标:得到公司基本价值评分和弹性评分</td></tr>
<tr><td rowspan="2">三</td><td colspan="2">公司价值总评分(0-100)
公司价值总评价=公司基本价值得分*[(公司弹性得分-50)/100*40%+1]
方法:以弹性评分对基本价值评分进行增减,其增减幅度不超过20%</td></tr>
<tr><td colspan="2">目标:得到公司价值总评分的排序</td></tr>
</table>

C、股票价值优选模型使用的具体指标

1)公司价值优选评价

a、持续为股东创造价值的能力,以EVA比率衡量;

b、投资管理能力,以对外投资回报率、投入资本回报率的加权指标进行衡量;

c、行业地位和持续经营能力,以主营收入规模为评价基础,并将投资收益综合到主营业收入当中,计算出调整后的主营业收入。

d、毛利率=主营业务利润/主营业务收入

e、管理费用比率=管理费用/主营收入

f、付息债务管理能力,以负债边际收入、边际负债率等指标进行衡量

2)公司弹性评价—对成长性的考量

a、收入倍率RI=营业收入/(净资产+经营性负债)

b、在建工程弹性=在建工程/固定资产净值

c、负债弹性=付息负债/总资产

通过上述指标的评分,得到以公司价值总评分为基准的排名,从而优选出高品质的公司。

D、人工优化分析

在数量模型分析的基础上,本基金将结合实地公司调研,全面深入地考察公司未来的发展战略和策略、核心竞争力、公司提供的产品、市场条件及变化趋势、公司治理结构、公司管理团队素质等,多层全方位的评估公司的成长性和投资价值,在优质个股中进行精选,提高投资的安全性和收益性。

精选出的个股企业具有如下的特征:明晰的公司发展战略、较高的公司素质、良好的成长性、已经形成核心竞争力、公司提供的产品具有巨大而增长的市场需求、良好的市场条件、公司治理结构完善,决策层的高素质。其中,核心竞争力是一种扎根于企业组织内部的、能获得超额收益和能够不断使自己立于竞争优势地位的一种能力。核心竞争力具有稀缺性、价值性和难以模仿的特征。企业的技术、品牌、网络、资金、规模、先进的企业文化、价值观和丰富的市场经验等,综合起来就是企业的核心竞争力。本基金在选择公司时将重点关注该公司是否具备突出的核心竞争力。决策层的素质包括决策层的前瞻性、创新性和人格魄力。具备这些特点的决策层,更有能力发现并把握其他竞争者看不到的机遇,使企业获得更长久的生存空间和增长空间。

3、固定收益类资产投资策略

为提高基金资产投资组合的流动性,有效控制基金组合的风险,本基金对固定收益类资产比例进行稳健的配置。通过久期控制下的主动投资策略,在严格控制风险的前提下,保障资金的安全性和流动性。本基金将根据对宏观经济、货币政策和市场供求关系的综合分析,定期调整类属资产的配置,同时结合个券选择策略,调整债券品种。

(1)固定收益类资产投资组合的构建

在固定收益投资组合的构建过程中,本基金以实现整体资产组合目标为前提,通过严格控制久期的投资策略,结合宏观经济、市场利率、供求变化以及各券的流动性水平、风险收益水平、信用水平等因素进行综合分析,确定类属资产的具体配置比例,从而构建固定收益类资产的投资组合。

图:本基金固定收益投资组合构建流程图

固定收益投资组合的构建流程具体如下:

(下转B55版)