（上接B105版）

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

法定代表人：刘明军

联系人：刘鸣

电话：0755-86013388-77386

传真：

客户服务电话：95017（拨通后转1转8）

网站：www.tenganxinxi.com、www.txfund.com

（88）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室

法定代表人：吴言林

联系人：林伊灵

电话：025-66046166（分机号转810）

传真：025-53086966

客户服务电话：025-66046166

网站：www.huilinbd.com

（89）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-54967552

传真：021-54967293

客户服务电话：95323

网站：www.cfsc.com.cn

3、场内销售机构

场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：http://www.sse.com.cn

长信利丰债券型证券投资基金E类销售机构：

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼	
法定代表人：成善栋	联系人：陈竹君
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
2、场外代销机构	
（1）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：季平伟
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com

本基金场外非直销机构的变化情况请关注本公司官方网站相关信息。

（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	利丰A类、E类注册登记机构	利丰C类注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	长信基金管理有限责任公司	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	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	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	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	上海市浦东新区世纪大道100号50楼
法定代表人	成善栋	周明	廖海（负责人）	毛鞍宁
联系电话	021-61009999	010-59378856	021-51150298	021-22282551
传真	021-61009800	010-59378907	021-51150398	021-22280071
联系人	孙红辉	崔巍	廖海、刘佳	蒋燕华（蒋燕华、沈熙苑为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信利丰债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

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

七、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

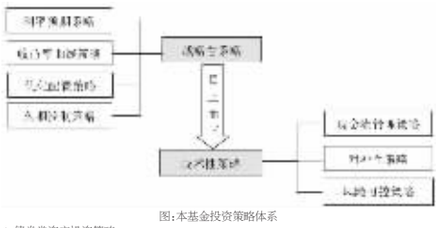
如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的20%；投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的20%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。

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



图：本基金投资策略体系

1、债券类资产投资策略

A、利率预期策略

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

B、收益率曲线策略

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

C、优化配置策略

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

D、久期控制策略

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

E、风险可控策略

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

F、现金流管理策略

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

G、对冲性策略

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

2、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

3、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券。本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于这类金融工具。在具体品种和分支的选择上，本基金主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券各个分支的风险与收益状况进行评估，根据基金投资组合管理的目标选择合适的分支进行投资。

4、新股申购投资策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差。在我国证券市场上，新股申购是一种风险较低的投资方式。本基金将研究股票首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

5、股票投资策略

本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的个股选择策略。在“自上而下”的分析中，本基金将在经济运行周期的分析框架下，通过国家分析和行业分析进行深度的研究和预测，具体包括长期和短期的国家经济周期、行业特征、行业运行趋势、行业周期、产业政策等多因素的分析和预测，确定各经济变量和其他影响因素的变动对各行业的潜在影响，寻找出最具投资价值的行业。基于行业的分析选取，再对其中具有竞争力的上市公司进行投资。在“自下而上”的分析中，本基金将在相对投资价值和投资时机分析的基础上，挑选具有投资价值和发展潜力的上市公司。具体包括：长信品质分析模型、估值模型和风险收益分析三个方面。

（1）长信基金的品质评估模型包括：财务品质评估、经营品质评估，从多个角度的对上市公司的情况进行分析和评估。在财务品质评估中，分析的因素包括：盈利能力、成长能力、股本扩张能力、现金流量、营运能力、财务预警；在经营品质评估中，分析的因素包括：经营环境、公司竞争力、管理能力、公司治理结构。

（2）估值分析：个股的估值主要是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、Franchise P/E模型等针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。

（3）风险因素分析：风险因素分析主要是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析。另一个是利用对风险的影响因素，利用线性回归模型对风险因素进行敏感性分析。

6、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资；首先综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，对权证的合理价值做出判断；其次基于权证的价值分析以及对权证标的股票未来走势的预期，对权证进行单向投资；最后基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资。

九、基金的业绩比较基准

中证全债指数×90%+中证800指数×10%

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

十、基金的风险收益特征

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

十一、基金的投资组合报告

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日（摘自本基金2019年1季报），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	450,813,257.70	15.38
	其中：股票	450,813,257.70	15.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,408,390,669.68	82.17
	其中：债券	2,408,390,669.68	82.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,337,025.57	0.69
8	其他资产	51,451,874.69	1.76
9	合计	2,930,992,827.64	100.00

注：本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	261,879,191.05	11.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,121,189.85	2.73
J	金融业	86,922,723.00	3.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,192,292.80	0.66
M	科学研究和技术服务业	14,256,000.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,441,861.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	450,813,257.70	19.48

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300054	鼎龙股份	6,927,000	69,270,000.00	2.99
2	601166	兴业银行	2,761,900	50,183,723.00	2.17
3	002466	天齐锂业	718,300	25,255,428.00	1.09
4	600196	复星医药	770,000	22,930,600.00	0.99
5	300383	光环新网	1,200,083	22,501,556.25	0.97
6	002415	海康威视	516,100	18,099,627.00	0.78
7	600887	伊利股份	606,055	17,642,261.05	0.76
8	000333	美的集团	360,000	17,542,800.00	0.76
9	601211	国泰君安	760,000	15,314,000.00	0.66
10	601888	中国国旅	216,785	15,192,292.80	0.66

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	668,165,917.00	28.87
	其中：政策性金融债	663,159,417.00	28.65
4	企业债券	544,324,745.40	23.52
5	企业短期融资券	20,006,000.00	0.86
6	中期票据	730,412,000.00	31.56
7	可转债（可交换债）	395,612,007.28	17.09
8	同业存单	49,870,000.00	2.15
9	其他	-	-
10	合计	2,408,390,669.68	104.06

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180204	18国开04	1,200,000	125,700,000.00	5.43
2	132009	17石油EB	1,180,000	120,242,000.00	5.20
3	190202	19国开02	1,000,000	99,890,000.00	4.32
4	160215	16国开15	800,000	80,072,000.00	3.46
5	101754014	17恒健MTN001	700,000	71,687,000.00	3.10

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

（十）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	274,809.58
2	应收证券清算款	17,468,804.84
3	应收股利	-
4	应收利息	33,567,569.76
5	应收申购款	140,690.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,451,874.69

4、本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113013	国君转债	71,046,000.00	3.07
2	113011	光大转债	60,881,100.00	2.63
3	110034	九州转债	3,164,637.20	0.14
4	110042	航电转债	2,654,188.50	0.11
5	113509	新泉转债	2,349,615.70	0.10
6	123009	星源转债	1,051,284.00	0.05
7	128019	久立转2	218,951.88	0.01

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩部分

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。

（一）基金各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

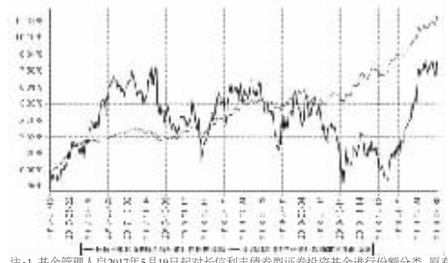
长信利丰债券C

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
2008年12月29日至2009年12月31日	3.74%	0.30%	6.46%	0.24%	-2.72%	0.06%
2010年	10.81%	0.33%	2.29%	0.18%	8.52%	0.15%
2011年	-6.92%	0.35%	2.17%	0.18%	-9.09%	0.17%
2012年	12.77%	0.34%	3.95%	0.14%	8.82%	0.20%
2013年	5.71%	0.49%	-0.98%	0.17%	6.69%	0.32%
2014年	33.30%	0.54%	14.26%	0.14%	19.04%	0.40%
2015年	27.54% 0.54% 4.34% 0.18% 3.93% 0.36%	0.80%	10.10%	0.26%	17.44%	0.54%
2016年	-4.68%	0.43%	0.62%	0.18%	-5.30%	0.25%
2017年	1.08%	0.34%	1.16%	0.09%	-0.08%	0.25%
2018年	-3.42%	0.50%	4.74%	0.14%	-8.16%	0.36%
2019年1月1日至2019年3月31日	8.79%	0.45%	4.02%	0.15%	4.77%	0.30%

长信利丰债券E

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
2017年5月19日-2017年12月31日	3.08%	0.40%	2.51%	0.08%	0.57%	0.32%
2018年	-3.35%	0.50%	4.74%	0.14%	-8.09%	0.36%
2019年1月1日至2019年3月31日	8.69%	0.44%	4.02%	0.15%	4.67%	0.29%

（二）自合同生效之日（2008年12月29日）至2019年3月31日期间，本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比：



注：1、基金管理人自2017年5月19日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为C类份额，增设E类份额。

2、长信利丰债券C图示日期为2008年12月29日至2019年3月31日，长信利丰债券E图示日期为2017年5月19日（份额增加日）至2019年3月31日。

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

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用包括：

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）销售服务费；

（4）基金合同生效后的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金财产拨划支付的银行费用；

（9）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为0.7%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.2%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C、E两类基金份额的销售服务费年费率均为0.4%。本基金C、E两类基金份额销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出，由该类基金份额注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

4、上述1中（4）到（9）项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

5、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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

6、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和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

7、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

（二）与基金销售有关的费用

本基金将基金份额分为A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额三种。本基金的A类基金份额在申购时收取申购费，本基金的C类、E类基金份额不收取申购费用，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

1、申购费用

投资者在申购本基金时交纳申购费用，申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金A类、C类和E类基金份额的申购费率如下：

基金份额类别	单笔申购金额（M，含申购费）	申购费率
A类基金份额	M＜100万元	0.8%
	100万元≤M＜500万元	0.5%
	M≥500万元	每笔1000元
C类基金份额	0	
E类基金份额		

注：M为申购金额

2、赎回费用

本基金各类基金份额的赎回费用在基金投资者赎回本基金该类份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减。其中，对持续持有期少于7 日的投资者收取1.5%的赎回费；除此之外，C类、E类赎回费率相同，具体费率如下：

费用种类	持有时间（Y）	赎回费率
A类基金份额	Y＜7天	1.50%
	7天≤Y＜3个月	0.30%
	3个月≤Y＜12个月	0.10%
	1年≤Y	0
C类、E类基金份额	Y＜7天	1.50%
	7天≤Y	0.10%

注：Y为持有期限

3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日内在至少一种指定媒介和基金管理人的公司网站上公告。

4、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）等进行基金交易的基金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，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后对基金投资者适当调整基金基金赎回费率和基金转换费率。

5、本基金的赎回费用由赎回基金份额持有人承担，其中，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；除此之外，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6、基金的转换费用

本公司已开通了长信利丰债券基金C类份额（C类代码：519989）与长信利息收益货币基金A、B级份额（A级代码：519999；B级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信低碳壹号信息披露基金A类份额（A类代码：519985）、长信双利优势混合基金、长信双利优选混合基金A类份额（A类代码：519991）、长信量化先锋混合基金A类份额（A类代码：519983）、长信内需成长混合基金A类份额（A类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金A类份额（A类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利保债券基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金A类份额（A类代码：519949）、长信上证港股通指数型发起式基金、长信富民纯债一年定开债券基金、长信富海纯债一年定开债券基金、长信先优债券基金、长信中证500指数基金、长信乐信混合（非直销渠道）、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金基金（非直销渠道）、长信价值优选混合基金、长信利率债债券基金、长信合利混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司已开通了长信利丰债券基金E类份额（C类代码：004651）与长信长金通货币基金A、B级份额（A级代码：005134；B级代码：005135）、长信沪深300指数基金A类份额（A类代码：005137）、长信国防军工量化混合基金、长信稳健纯债基金、长信稳益纯债基金、长信稳势纯债基金、长信纯债壹号债券基金C类份额（C类代码：004220）、长信乐信混合基金（直销渠道）、长信量化先锋混合基金C类份额（C类代码：004221）、长信消费精选股票基金（直销渠道）、长信量化多策略股票基金C类份额（C类代码：004858）、长信量化价值驱动混合基金、长信双利优选混合基金E类份额（E类代码：006396）、长信内需成长混合基金E类份额（E类代码：006397）、长信利息收益货币基金A、B级份额（A级代码：519999；B级代码：519998）（直销渠道）之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司于2017年6月30日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数型发起式证券投资基金暂停转换转出和转换转入业务的公告》，自2017年7月4日起，暂停长信上证港股通指数型发起式基金的转换转入和转换转出业务。

根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

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

（2）转换份额的计算公式：

1）非货币基金之间转换

转出确认金额＝转出份额×转出基金份额净值

赎回费＝转出确认金额×赎回费率

补差费＝(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额＝转出确认金额－赎回费－补差费

转入确认份额＝转入确认金额÷转入基金份额净值

（若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零）

2）货币基金转至非货币基金

转出确认金额＝转出份额×转出基金份额净值＋转出份额对应的未结转收益

补差费＝转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额＝转出确认金额－补差费

转入确认份额＝转入确认金额÷转入基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费)

3）非货币基金转至货币基金

转出确认金额＝转出份额×转出基金份额净值

赎回费＝转出确认金额×赎回费率

转入确认金额＝转出确认金额－赎回费

转入确认份额＝转入确认金额÷货币基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，补差费为零)

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书（《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“二、释义”十七、基金的信息披露”等部分，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了相应的内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一九年十二月三十一日

证券代码：600309　证券简称：万华化学　公告编号：临2019-95号

万华化学集团股份有限公司第七届董事会2019年第九次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

● 公司全体董事出席本次会议。

一、董事会会议召开情况

（一）本次董事会会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

（二）本次董事会于2019年12月26日以电子通讯的方式发出董事会会议通知及材料。

（三）本次董事会于2019年12月30日采用通讯表决的方式召开。

（四）本次董事会会议应出席的董事11人，实际出席会议的董事人数11人。

（五）会议由公司董事长廖增太先生主持，公司监事列席会议。

二、董事会会议审议情况

（一）审议通过《关于调整部分募集资金投资项目实施进度的议案》，赞成票11票，反对票0票，弃权票0票；

详细内容参见公司于同日披露的临2019-97号公告。

三、备查文件

万华化学集团股份有限公司第七届董事会2019年第九次会议决议

特此公告。

万华化学集团股份有限公司董事会

2019年12月31日

证券代码：600309　证券简称：万华化学　公告编号：临2019-96号

万华化学集团股份有限公司第七届监事会2019年第八次会议决议公告

本公司监事会及全体监事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

● 公司全体监事出席本次会议。

一、监事会会议召开情况

（一）本次监事会会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

（二）本次监事会于2019年12月26日以电子通讯的方式发出监事会会议通知及材料。

（三）本次监事会于2019年12月30日采用通讯表决的方式召开。

（四）本次监事会会议应出席的监事5人，实际出席会议的监事人数5人。

（五）会议由公司监事会召集人孙晓先生主持。

二、监事会会议审议情况

（一）审议通过《关于调整部分募集资金投资项目实施进度的议案》，赞成票5票，反对票0票，弃权票0票。

三、备查文件

万华化学集团股份有限公司第七届监事会2019年第八次会议决议

特此公告。

万华化学集团股份有限公司监事会

2019年12月31日

证券代码：600309　证券简称：万华化学　公告编号：临2019-97号

万华化学集团股份有限公司关于调整部分募集资金投资项目实施进度的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

●万华化学集团股份有限公司（以下简称“公司”、“万华化学”）将募投项目“聚碳酸酯项目”、“上海中心项目”的实施进度调整至2020年6月30日前完成。

●本次调整募投项目“聚碳酸酯项目”、“上海中心项目”实施进度的事项已经2019年12月30日召开的公司第七届董事会2019年第九次会议、第七届监事会2019年第八次会议审议通过，无需提交公司股东大会审议。

一、募集资金投资项目的概述

2016年7月13日，中国证券监督管理委员会发行审核委员会审核通过了万华化学非公开发行股票申请。

2016年8月30日，本公司收到了中国证监会出具的《关于核准万华化学集团股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2016]1805号），核准公司非公开发行不超过157,629,255股新股。

2017年1月6日，山东和信会计师事务所（特殊普通合伙）出具了和信验字(2017)第000002号《验资报告》。截至2017年1月6日止，本公司募集资金总额为人民币2,499,999,984.00元，扣除承销商发行费用37,735,849.06元（不含税）及与发行有关的其他费用人民币1,839,622.64元（不含税）后，实际募集资金净额应为2,460,424,512.30元，其中新增注册资本人民币116,009,280.00元，股本溢价人民币2,344,415,232.30元。

为规范公司募集资金管理和使用，保护投资者权益，