

长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之长信一带一路份额上市交易公告书

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2016年2月1日
公告时间:2016年1月27日

《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之长信一带一路份额上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人长信基金管理有限责任公司(以下简称“我公司”)的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、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。

本基金托管人广发证券股份有限公司保证本公告书基金财务会计核算内容内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。
 凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2015年6月23日登载于《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易网站(<http://www.sse.com.cn/>)以及长信基金管理有限责任公司网站(<http://www.cxfund.com.cn/>)的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

二、基金概况

- 基金名称:长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金
- 本次上市交易的基金份额场内简称及交易代码:基础份额简称:带路分级;基金代码:502016
- 基金类型:股票型
- 基金运作方式:契约型开放式
- 基金份额分级

本基金的基金份额包括长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(即“长信一带一路份额”)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“长信一带一路A份额”)与长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“长信一带一路B份额”)。其中,长信一带一路A份额、长信一带一路B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

6、长信一带一路份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对长信一带一路份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合上海证券交易所风险控制要求的上海证券交易会员席位单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

7、长信一带一路份额的跨系统转托管:基金份额持有人可以将持有的长信一带一路份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行跨系统转托管。

8、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的长信一带一路份额和长信一带一路A份额、长信一带一路B份额之间的配对转换,包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份长信一带一路份额的场内份额申请转换成1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额的行为;合并指基金份额持有人将其持有的每1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额申请转换成2份长信一带一路份额的场内份额的行为。本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并,长信一带一路份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、不定期份额折算
 在本基金存续期内,每年12月15日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日;若距离上一次基金份额折算不满3个月则可不进行折算),本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

定期份额折算后长信一带一路A份额的基金份额参考净值调整为1.000元,基金份额折算基准日折算前长信一带一路A份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为长信一带一路份额的场内份额分配给长信一带一路A份额持有人。长信一带一路份额持有人持有的每两份长信一带一路份额将按一份长信一带一路A份额获得新增长信一带一路份额的分配,经过上述份额折算后,长信一带一路份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的份额配比保持1:1的比例。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

10、不定期份额折算
 除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算,即:当长信一带一路份额的基金份额净值高于1.500元或以上;当长信一带一路B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额:截至2016年1月25日,本基金的基金份额总额为21,973,583.54份,其中,长信一带一路基金份额16,604,865.54份,A类份额为2,684,359.00份,B类份额为2,684,359.00份。

12、本次上市交易的基金份额总额:截至2016年1月25日,一带一路基础份额为145,802.00份。

13、基金份额参考净值:截至2016年1月25日,一带一路基础份额净值为0.976元。

14、上市交易的证券交易所:上海证券交易所

15、上市交易日期:2016年2月1日

基金管理人:长信基金管理有限责任公司

17、基金托管人:广发证券股份有限公司

18、上市推荐人:无

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2015年6月11日证监许可【2015】1212号

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金合同期限:不定期

4、发售日期:2015年7月6日至2015年8月10日

5、发售期限:26个工作日

6、发售价格:1.00元人民币

7、发售方式:场外、场内认购

8、发售机构:

(1)场内发售机构

具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位(名单详见上海证券交易网站)

(2)场外发售机构

1)直销机构:长信基金管理有限责任公司

2)代销机构:

交通银行股份有限公司、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、平安银行股份有限公司、长信证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、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、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、江海证券股份有限公司、中航证券有限公司、平安证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、西藏同信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中山证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海好基宝基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海汇付金融服务有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、大泰金石投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司等。

9、验资机构名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

10、募集资金总额及认购情况:募集期间净认购金额215,606,836.28元人民币,该资金已于2015年8月13日全额划入本基金托管人在中国建设银行有限责任公司广州天河支行开立的本基金托管专户;认购资金的银行利息共计61,351.31元,已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户。本基金按照每份基金份额1.00元计算,募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计215,668,187.50份。募集期间基金

管理人的从业人员认购的基金份额共计2,290.76份,占基金总份额比例0.0%,募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金10,014,750.00份,占基金总份额比例0.464%。

11、本基金募集备案情况:本基金于2015年8月13日验资完毕,2015年8月14日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2015年8月17日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日:2015年8月17日。

13、基金合同生效日的基金份额总额215,668,187.50份。

(二)一带一路基础份额上市交易的主要内容:

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管

决定书[2016]016号

2、上市交易日期:2016年2月1日

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市的基础份额简称及交易代码

基础份额简称:带路分级;

交易代码:502016

5、基金场内申购、赎回简称:带路分级

6、场内申购、赎回代码:502016

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构,并予以公告。

7、本次上市交易份额:基础份额为145,802.00份(截至2016年1月25日)

8、基金资产净值的披露:基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

9、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的场外份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管至中国证券登记结算有限

责任公司上海分公司证券登记结算系统持有上海证券账户下后,即可在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管及份额配对转换业务已于2015年8月24日开通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2016年1月25日,本基金基础份额持有人户数为1,185户(场外

户数与拆分后的场内户数之和),平均每户持有的基金份额为14,012.54

份。其中,场内基础份额持有人数为331户,平均每户持有的基础基金份额为440.49份。

(二)持有人结构

截至2016年1月25日,机构投资者持有的本次上市交易的场内基础

基金份额为234.00份,占本次基础份额上市交易基金份额比例为0.16%;

个人投资者持有的本次上市交易的场内基础基金份额为145,568.800份,

占本次基础份额上市交易基金份额比例为99.84%。

(三)前十名基金份额持有人的情况

截至2016年1月25日,基础份额前十名场内基金份额持有人的情况

如下表:

序号	持有人名称(全称)	持有场内基础份额(份)	占场内基础份额比例
1	李伟亚	99,748.00	68.41%
2	黄伟南	2,246.00	1.54%
3	吴建生	2,244.00	1.54%
4	王鹏	1,871.00	1.28%
5	李云海	1,721.00	1.18%
6	吴桂彬	1,371.00	0.94%
7	胡彬彬	1,124.00	0.77%
8	冯薇	1,121.00	0.77%
9	庞力军	749.00	0.51%
10	孙凤环	749.00	0.51%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称:长信基金管理有限责任公司

2、法定代表人:叶华

3、总经理:覃波

4、注册资本:1.5亿元人民币

5、注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号9楼

6、设立批准文号:中国证监会证监基金【2003】163号

7、工商登记注册的法人营业执照文号:310101000315489

8、经营范围:基金管理业务,发起设立基金,中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动】

9、存续期间:持续经营

10、股东及其实出资比例:

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%
	上海欧集投资有限公司	514.95万元	34.33%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5万元	16.67%
	总计	15000万元	100%

11、内部组织结构及职能

股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会。我公司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。根据我公司发展战略和组织管理原则,结合基金管理的业务特点,在经营管理层下设内部控制委员会、投资决策委员会等非常设委员会,以及投资管理部,研究发展部、交易管理部、固定收益部、量化投资部、产品开发部、专户理财部、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、国际业务部、电子商务部、财务管理部、机构服务部、专户理财部共18个部门,并设立了北京分公司、深圳分公司和武汉办事处。

投资管理部

负责A股非固定收益类基金资产的投资运作和管理业务。

研究发展部

负责投资组合的基础研究,主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息,研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情況,为投资组合的投资决策提供建议和依据。

交易管理部

负责制定交易管理的基本制度,核查指令的合规性,准确及时地执行交易指令,进行市场分析、询价,维护有关交易数据,协调与交易相关的业务关系等。

固定收益部

负责分析和研究经济、货币政策和财政政策等有关信息,向投资决策委员会提供固定收益证券的投资策略和资产配置建议,负责公司固定收益类基金的投资运作和管理业务。

量化投资部

负责各类投资组合的风险与业绩评估、数量分析研究、量化投资研究等工作等。

产品开发部

负责公司公募基金的产品设计开发工作和产品申报工作。

专户理财部

负责特定客户资产管理业务的运作和管理工作。

基金事务部

负责各类投资组合资产的清算、会计核算、注册登记、直销客户业务办理等业务。

零售服务部

负责新基金发行以及基金日常持续营销的营销策划,营销方案实施,销售支持,品牌宣传,渠道维护,后台管理等工作,为客户提供增值服务。

机构业务部

负责公司机构客户的开拓、维护、服务,为机构客户提供专业服务,根据客户需求提供各类产品和解决方案。

信息技术部

负责提供信息系统支持,保障公司日常经营正常运转。

监察稽核部

在公司内部行使监察稽核职能,负责公司的法律事务、信息披露、各项业务的常规监察稽核和专项监察稽核等工作,在业务上接受督察长和内部控制委员会的指导 and 监督。

综合行政部

全面负责公司的行政后勤、人力资源的开发与管理等工作。

国际业务部

负责公司国际业务的开发和拓展工作。

电子商务部

负责公司电子商务平台建设,公司网站及网上直销系统功能策划,完善网站、微博及微信的营销、宣传、服务功能。

财务管理部

负责公司财务管理及自有资产管理等工作。

机构服务部

负责承接特定客户资产管理业务的支持性工作。

专户投资部

负责特定客户资产管理业务的投资运作等工作。

北京分公司

负责公司与中国证监会、托管银行等相关部门的沟通与联系,负责北京地区的各项业务的拓展工作。

深圳分公司

主要负责公司在华南地区的各项业务的拓展工作,同时负责公司与深圳证监局、总部设在华南的银行等相关部门的沟通与联系。

武汉办事处

负责公司在华中地区的各项联络性事务,不从事经营性活动。

12、人员情况:

截至2016年1月25日,公司现有正式员工142人,博士学历3人,占2%;硕士学历72人,占51%;本科学历60人,占42%;专科学历4人,占3%;其它3人,占2%。

13、信息披露负责人及咨询电话:

周永刚,(021)61009999

14、基金客户服务简介:

目前公司已具有发起设立公募基金、特定客户资产管理业务和合格境内机构投资者(QDII)业务资格、受托管理保险资金业务资格。

截至2016年1月25日,我公司目前已有39只开放式基金获批,其中已成立31只,1只已获批正在发行,1只发行结束尚未成立,6只已获批未发行。这39只已获批基金分别为:2只货币型基金(其中1只已获批未发行)、14只债券型基金(其中1只发行结束尚未成立,2只已获批未发行)、16只混合型基金(其中1只已获批正在发行,1只已获批未发行)、6只股票型基金(其中2只已获批未发行,1只QDII基金。专户理财业务方面,我公司现管理14只“一对一”资产管理计划和25只“一对多”资产管理计划。

公司最近一年内没有因违法违规行为受到行政处罚或者刑事处罚,没有因违法违规行为正在被监管机构调查,或者处于整改期间,不存在对基金运作已经造成或可能造成不良影响的重大变更事项,或者诉讼、仲裁等其他重大事件,不存在公司治理不健全、经营管理混乱、内部控制和风险管理制度无法得到有效执行、财务状况恶化等重大经营风险。

15、本基金基金经理:

左金保,经济学硕士,武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司,从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员,现任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。

邓晓,经济学硕士,武汉大学金融工程专业研究生毕业,具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员,2015年6月加入长信基金管理有限责任公司,现任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场6楼、7楼、18楼、19楼、38楼、39楼、40楼、41楼、42楼、43楼和44楼

法定代表人:孙树明

成立时间:1994年1月21日

基金托管资格批文及文号:证监许可【2014】510号

注册资本:人民币7,621,087,664元

存续期间:长期

托管部门负责人:刘洋

信息披露负责人:王玮

电话:020-87555888

2、托管部门主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司,先后担任广发证券股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘先生于2000年7月获得北京大学理学学士,并于2003年7月获得北京大学经济学硕士学位。

3、托管业务主要组织架构

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责,不断加强风险管理和内部控制,确保基金资产的安全性和独立性,切实维护基金份额持有人的合法权益,提供高质量的基金托管服务。

(三)上市推荐人

无

(四)基金验资机构

名称:毕马威华振会计师事务所

法定代表人:魏建华

注册地址:北京东长安街1号东方广场东2座8层

联系电话:(021)22122988

经办注册会计师:石海云、陈启明

六、基金合同摘要

(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、基金份额持有人权利和义务

基金份额持有人持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金份额持有人依据《基金合同》取得的基金份额,即成为本基金份额持有人及《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签署或签字为必要条件。

长信一带一路A份额、长信一带一路B份额、长信一带一路份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等

的权利包括但不限于:

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

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)依照法律法规及基金合同的规定,依法转让其持有的长信一带一路份额、长信一带一路A份额与长信一带一路B份额,依法申请赎回其持有的长信一带一路份额;

4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人权利包括但不限于:

1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

5)在其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;

6)不得从事任何有损基金份额及其他《基金合同》当事人合法权益的活动