长信量化中小盘股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2018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:交通银行股份有限公司

长信量化中小盘股票型证券投资基金(以下简称"本基金")已于2012年3月27日获中国证监会《关于核准长信量化中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]402号)核准募集。为保护投资者利益,基金管理人于2012年8月23日向中国证监会提交了《长信基金管理有限责任公司关于推迟长信量化中小盘股票型证券投资基金募集时间的申请》。根据《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》和《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定,基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,对本基金进行变更注册。变更注册后的本基金于2014年12月15日经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1360号文准予注册。本基金的基金合同于2015年2月4日正式生效。本基金为股票型契约开放式基金。

重要提示

长信基金管理有限责任公司(以下简称"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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。

本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券、期货市场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等。

本基金为股票型基金,其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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2018年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(财务数据未经审计)。

一、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	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	壹亿陆仟伍佰万元人民币		
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	成善栋		
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。【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】		
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	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5万元	31.21%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心(有限合伙)	751万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心(有限合伙)	749万元	4.54%
	总计	16500万元	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
成善栋	董事长	男	中共党员,硕士研究生,IMBA,曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员,中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长,上海巴黎国际银行信贷部总经理,工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长,并历任上海市金融学会副秘书长、上海城市金融学会副会长、秘书长。
刘元瑞	非独立董事	男	中共党员,硕士研究生,现任长江证券股份有限公司总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管,长江证券承销保荐有限公司总裁助理,长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
陈谋亮	非独立董事	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。现任上海市湖北商会常务副会长,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、总裁。
何宇城	非独立董事	男	中共党员,硕士,MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师,宝钢资金管理处费用综合管理,宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管,宝钢股份成本管理处综合主管,宝钢股份财务部预算室综合主管,宝钢股份财务部副部长,宝钢分公司炼钢厂副厂长,不锈钢分公司副总经理,宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。
覃波	非独立董事	男	中共党员,硕士,上海国家会计学院EMBA毕业,具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。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、副总经理。
吴稼祥	独立董事	男	经济学学士,研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。
谢红兵	独立董事	男	中共党员,学士。曾任营教导员、军直属政治处主任,交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长,交通银行基金托管部副总经理,长信基金管理有限公司董事长,中国交银保险(香港)副董事长。
徐志刚	独立董事	男	中共党员,经济学博士,曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记,中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任,金融调研室主任、浦东分行副行长,上海实业(集团)有限公司董事、副总裁,上海实业金融控股有限公司董事、总裁,上海实业财务有限公司董事长、总经理,德勤企业咨询(上海)有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
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
吴伟	监事会主席	男	中共党员,研究生学历。现任武汉钢铁股份有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长,武汉钢铁股份有限公司计划财务部副部长。
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业务总部总经理助理、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总经理助理兼零售服务部总监,曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。
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总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。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综合行政部总监兼人力资源总监。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
覃波	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。
邵彦明	副总经理	男	硕士,毕业于对外经济贸易大学,具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金,历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
李小羽	副总经理	男	上海交通大学工学学士,华南理工大学工学硕士,具有基金从业资格,加拿大特许投资经理资格(CIM),曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co.,Ltd。2002年加入本公司(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、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)和长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
程燕春	副总经理	男	华中科技大学技术经济学士,具有基金从业资格,现任长信基金管理有限责任公司副总经理,曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长,中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员,融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事,金元惠理基金管理有限公司首席市场官,历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。

注:

1、上述人员之间均不存在近亲属关系;

2、本公司于2018年8月28日发布了《长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告》,增聘安昀先生为本公司副总经理。

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
左金保	基金经理	自2015年3月14日起至今	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。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理。现任量化投资部总监、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理。
胡倩	基金经理	自2015年2月4日起至2015年3月14日	曾任本基金的基金经理。

注:

1、自2018年8月9日起,左金保先生开始担任长信量化价值驱动混合型证券投资基金的基金经理;

2、自2018年8月31日起,左金保先生开始担任长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理;

3、自2018年9月5日起,左金保先生不再担任长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
李小羽	副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理
常松	总经理助理兼固定收益及策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理
安昀	总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信内需成长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和长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
杨帆	国际业务部副总监、投资决策委员会执行委员、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理
高远	研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理
易利红	股票交易部总监
张文琍	固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理
陆莹	现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理
邓虎	养老FOF投资部总监兼基金经理
叶松	权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金和长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
左金保	量化投资部总监、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理
张飒岚	固收专户投资部总监兼投资经理
姚奕帆	量化专户投资部投资经理
秦娟	混合债券部总监
李欣	债券交易部副总监
陈言午	专户投资部投资经理

注:

1、上述人员之间均不存在近亲属关系;

2、自2018年8月9日起,左金保先生开始担任长信量化价值驱动混合型证券投资基金的基金经理;

3、自2018年8月16日起,叶松先生开始担任长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;

4、本公司于2018年8月28日发布了《长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告》,增聘安昀先生为本公司副总经理;

5、自2018年8月31日起,常松先生不再担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;

6、自2018年8月31日起,高远先生开始担任长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理;

7、自2018年8月31日起,左金保先生开始担任长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理;

8、自2018年8月31日起,陆莹女士开始担任长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;

9、自2018年9月5日起,杨帆女士开始担任长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;

10、自2018年9月5日起,左金保先生不再担任长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;

11、自2018年9月7日起,常松先生不再担任本公司投资决策委员会成员,聘任左金保先生为投资决策委员会执行委员;

12、自2018年9月7日起,姚奕帆先生不再担任本公司投资决策委员会成员,聘任涂世涛先生为投资决策委员会委员;

13、自2018年9月14日起,公司聘任卢靖女士为投资决策委员会委员。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:彭纯
住　　所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电　话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,较上年上升2位;根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年3月31日,交通银行资产总额为人民币92667.97亿元。2018年1-3月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币200.91亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称"托管中心")。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

彭纯先生,董事长、执行董事,高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月起任本行执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事,2013年10月至2018年1月任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

3、基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日,交通银行共托管证券投资基金350只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行,通过对各种风险的梳理、评估、监控,有效地实现对各项业务风险的管控,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。

2、内部控制原则

(1)合法性原则:托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)全面性原则:托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。

(3)独立性原则:托管中心独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金资产分别设置账户,独立核算,分账管理。

(4)制衡性原则:托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则,从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(5)有效性原则:托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障内控管理的有效执行。

(6)效益性原则:托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规,托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全、高效,包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理,技术系统规范管理,业务管理制度化,核心作业区实行封闭管理,有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理,聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

(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

交通银行作为基金托管人,根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定,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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,及时通知基金管理人予以纠正,基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的,交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有重大违规行为,有权立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

(四)其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

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)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:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座	
法定代表人:周慕冰	联系人:林葛
电话:010-66060069	传真:010-68121816
客户服务电话:95599	网址:www.abchina.com

(2)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:易会满	联系人:李鸿岩
电话:010-66105662	
客户服务电话:95588	网址:www.icbc.com.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:王洪章	联系人:张静
电话:010-67596084	
客户服务电话:95533	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:彭纯	联系人:王菁
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:李建红	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:上海市中山东一路12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

(7)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:姚健英
电话:010-58560666	传真:010-57092611
客户服务电话:95568	网址:www.cmbc.com.cn

(8)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	网址:www.hzbank.com.cn

(9)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	网址:bank.pingan.com

(10)江苏银行股份有限公司	
注册地址:南京市中华路26号	
办公地址:南京市中华路26号	
法定代表人:夏平	联系人:张洪玮
电话:025-58587036	传真:025-58587820
客户服务电话:95319	网址:www.jsbchina.cn

(11)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:尤习贵	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

(12)第一创业证券股份有限公司	
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼	
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼	
法定代表人:刘学民	联系人:吴军
电话:0755-23838751	传真:0755-25831754
客户服务电话:95358	网址:www.firstcapital.com.cn

(13)东吴证券股份有限公司	
注册地址:苏州工业园区星阳街5号	
办公地址:苏州工业园区星阳街5号	
法定代表人:范力	联系人:陆晓
电话:0512-62938521	传真:0512-65588021
客户服务电话:400 860 1555	网址:www.dwzq.com.cn

(14)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:95525	网址:www.ebscn.com

(15)广州证券股份有限公司	
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
法定代表人:邱三发	联系人:林洁茹
电话:020-88836999	传真:020-88836654
客户服务电话:020-961303	网址:www.gzs.com.cn

(16)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

(17)国都证券股份有限公司	
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:王少华	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

(18)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:四川省成都市东城根上街95号	
法定代表人:冉云	联系人:刘婧漪、贾鹏
电话:028-86690057、028-86690058	传真:028-86690126
客户服务电话:95310	网址:www.gjzq.com.cn

(19)国泰君安证券股份有限公司	
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路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:杨德红	联系人:芮敏祺
电话:95521	传真:021-38670666
客户服务热线:4008888666	网址:www.gtja.com

(20)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:周杨
电话:0755-82130833	传真:0755-82133952
客户服务电话:95536	网址:www.guosen.com

(21)华安证券股份有限公司	
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198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

(22)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

(23)华龙证券股份有限公司	
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:0931-4890208	传真:0931-4890628
客户服务电话:4006898888	网址:www.hlzqgs.com.cn

(24)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

(25)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

(26)平安证券股份有限公司	
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼	
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)	
法定代表人:杨宇翔	联系人:周一涵
电话:0755-22626391	传真:0755-82400862
客户服务电话:95511—8	网址:www.stock.pingan.com

(27)中泰证券股份有限公司	
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

(28)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:龚德雄	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

(29)申万宏源证券有限公司	
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层	
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层	
法定代表人:李梅	联系人:黄莹
电话:021-33389888	传真:021-33388224
客户服务电话:95523或4008895523	网址:www.swhysc.com

(30)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

(31)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:010-66045518
客户服务电话:010-66045678	网址:www.txsec.com

(32)西藏东方财富证券股份有限公司	
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

(33)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:上海市浦东新区长柳路36号	
法定代表人:杨华辉	联系人:乔琳雪
电话:021-38565547	
客户服务电话:95562	网址:www.xyzq.com.cn

(34)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

(35)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2-6层	
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:陈共炎	联系人:邓颜
电话:010-66568292	传真:010-66568990
客户服务电话:4008-888-888	网址:www.chinastock.com.cn

(36)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:张颢
电话:010-85130588	传真:010-65182261
客户服务电话:400-8888-108	网址:www.csc108.com

(37)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:侯艳红
电话:010-60838888	传真:010-60833739
客户服务电话:95558	网址:www.citics.com

(38)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

(39)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:深圳市福田区莲花街道益田路6013号江苏大厦B座15楼	
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:95329	网址:www.zszq.com.cn

(40)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:95321	网址:www.cindasc.com

(41)西南证券股份有限公司	
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号	
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦	
法定代表人:吴坚	联系人:张煜
电话:023-63786633	传真:023-63786212
客服热线:4008096096	网址:www.swsc.com.cn

(42)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	
办公地址:浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼	
法定代表人:陈柏青	联系人:韩爱彬
电话:0571-81137494	传真:4000-766-123
客户服务电话:4000-766-123	网址:www.fund123.cn

(43)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:上海市浦东新区东方路1267号11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:400-820-2899	网址:www.erichfund.com

(44)诺亚正行基金销售有限公司	
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

(45)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:苗汀
电话:021-58870011	传真:021-68596916
客户服务电话:4007009665	网址:www.ehowbuy.com

(46)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:021-20835779
客户服务电话:400-920-0022	网址:www.licaike.com

(47)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:朱钰
电话:021-54509998	传真:021-64385308
客户服务电话:400-1818-188	网址:fund.eastmoney.com

(48)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809	
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809	
法定代表人:沈伟桦	联系人:程刚
电话:010-52855713	传真:010-85894285
客户服务电话:4006099400	网址:www.yixinfund.com

(49)浙江同花顺基金销售有限公司	
注册地址:杭州市文二西路1号903室	
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼 2楼	
法定代表人:凌顺平	联系人:吴强
电话:0571-88911818	传真:0571-86800423
客户服务电话:4008-773-772	公司网站:www.5ifund.com

(50)上海汇付基金销售有限公司	
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼	
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼	
法定代表人:冯修敏	联系人:陈云卉
电话:021-33323999-5611	传真:021-33323830
客户服务电话:4008202819	网址:www.chinapnr.com

(51)上海陆金所基金销售有限公司	
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	
法定代表人:郭坚	联系人: 宁博宇
电话:021-20665952	传真:021-22066653
客户服务电话: 4008219031	网址:www.lufunds.com

(52)大泰金石基金销售有限公司	
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室	
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼	
法定代表人:袁顾明	联系人:朱真卿
电话:021-22267943	传真:021-22268089
客户服务电话:400-928-2266	网址:www.dtfunds.com

(53)上海联泰资产管理有限公司	
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室	
办公地址: 上海长宁区福泉北路518号8座3楼	
法定代表人:燕斌	联系人:陈东
电话:021-52822063	传真:021-52975270
客户服务电话:400-046-6788	网址: www.66zichan.com

(54)海银基金销售有限公司	
注册地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元	
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号6楼	
法定代表人: 刘惠	联系人:毛林
电话:021-80133597	传真:021-80133413
客户服务电话:4008081016	网址: www.fundhaiyin.com

(55)上海凯石财富基金销售有限公司	
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室	
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼	
法定代表人:陈继武	联系人:葛佳蕊
电话:021-80365020	传真:021-63332523
客户服务电话:4006433389	网址:www.vstonewealth.com

(56)上海利得基金销售有限公司	
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室	
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼	
法定代表人:李兴春	联系人:徐鹏
电话:86-021-50583533	传真:86-021-50583633
客户服务电话:400-921-7755	网站:http://a.leadfund.com.cn/

(57)珠海盈米财富管理有限公司	
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203	
法定代表人:肖雯	联系人:钟琛
电话:020-89629012	传真:020-89629011
客户服务电话:020-89629066	网站:www.yingmi.cn

(58)北京汇成基金销售有限公司	
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号	
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	
法定代表人:王伟刚	联系人:丁向坤
电话:010-56282140	传真:010-62680827
客户服务电话:400-619-9059	网站:www.hcjijin.com

(59)财通证券股份有限公司	
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716	
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716	
法定代表人:沈继宁	联系人:陶志华
电话:0571-87789160	传真:0571-87818329
客户服务电话:4008696336	网站:www.ctsec.com

(60)深圳前海微众银行股份有限公司	
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:广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼	
法定代表人:顾敏	联系人:罗曦
电话:0755-89462447	传真:0755-86700688
客户服务电话:400-999-8877	网站:www.webank.com

(61)上海华夏财富投资管理有限公司	
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室	
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	
法定代表人:李一梅	联系人:仲秋玥
电话:010-88066632	传真:010-88066552
客户服务电话:4008175666	网站:www.amcfortune.com

(62)和谐保险销售有限公司	
注册地址:北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302	
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街6号安邦金融中心	
法定代表人:蒋洪	联系人:张楠
电话:010-85256214	
客户服务电话:4008195569	网址:www.hx-sales.com

(63)一路财富(北京)信息科技股份有限公司	
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
法定代表人:吴雪秀	联系人:徐越
电话:010-88312877-8032	传真:010-88312099
客户服务电话:400-001-1566	网址:www.yilucaifu.com

(64)嘉实财富管理有限公司	
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元	
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	
法定代表人:赵学军	联系人:王宫
电话:021-38789658	传真:021-68880023
客户服务电话:400-600-8800	网站:www.jsfund.cn

(65)北京蛋卷基金销售有限公司	
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	
法定代表人:钟斐斐	联系人:戚晓强
电话:010-61840688	传真:010-61840699
客户服务电话:4000-618-518	网站:www.danjuanapp.com

(66)上海基煜基金销售有限公司	
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)	
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室	
法定代表人:王翔	联系人:张巍婧
电话:021-65370077-255	传真:021-55085991
客户服务电话:400-820-5369	网站:www.jiyufund.com.cn

(67)开源证券股份有限公司	
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
法定代表人:李刚	联系人:袁伟涛
电话:029-88447611	传真:029-88447611
客户服务电话:95325或400-860-8866	网站:www.kysec.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

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)其他相关机构

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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
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	上海市黄浦区延安东路222号30楼
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	上海市黄浦区延安东路222号30楼
法定代表人	周明	廖海(负责人)	曾顺福
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-61418888
传真	010-59378907	021-51150398	021-61411909
联系人	崔巍	廖海、刘佳	曾浩(曾浩、吴凌志为经办注册会计师)

四、基金的名称

长信量化中小盘股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小盘股票,通过数量化模型,合理配置资产权重,精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,投资于中小盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例范围是基金资产的5%-20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资模型,将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中,在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势,切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略,以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分:首先,通过自上而下的资产配置策略对宏观经济、资金与流动性和市场结构进行详尽的数量化分析,并据此判断股票市场和债券市场的走势,以指导本基金的大类资产配置;其次,通过自下而上的上市公司研究,借助"长信量化中小盘模型"选取具有较好成长潜力的中小市值上市公司股票。

1、资产配置策略

本基金采用"自上而下"的资产配置方法确定各类资产的配置比例。首先,本基金基于宏观经济情况及证券市场整体走势的前瞻性研究,通过研判股票市场和债券市场相对投资收益的周期性特征开展战略资产配置。其次,本基金将从资金与流动性、市场交易特征和市场结构特征等层面开展战术资产配置,在对证券市场当期的系统性风险及各类资产的预期风险收益特征进行充分分析的基础上,合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的投资权重,以达到控制风险、增加收益的目的。

2、股票投资策略

本基金采用"自下而上"的数量化选股策略重点投资于中小盘股票,在纪律化模型约束下,紧密跟踪策略,严格控制运作风险,并根据市场变化趋势,定期对模型进行调整,以改进模型的有效性,从而取得较高的收益。

(1)中小盘股票的定义

本基金对中小盘股票的定义如下:

对中国证券市场中所有上市交易的A股股票按照流通市值从小到大进行排序并相加,累计流通市值达到总流通市值70%的股票纳入中小盘集合;在此期间对于未被纳入最近一次排序范围内的股票(如新股、恢复上市股票等),则依据其流通市值或基金管理人预测的流通市值,参照最近一次排序的结果决定其是否纳入中小盘集合。

(2)个股精选——长信量化中小盘模型

本基金基于国内外证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验构建的"长信量化中小盘模型"将超额收益的来源归纳为成长因子、估值因子、基本面因子和流动性因子。

1)成长因子

本基金考察的成长因子可以参考以下指标:PEG、营业收入增长率、过去三年的每年净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率(留存收益率*净资产收益率)等;

2)估值因子

本基金考察的估值因子可以参考以下指标:市盈率(PE)、市净率(PB)、市现率(PCF)、市销率(PS)等;

3)基本面因子

本基金考察的基本面因子可以参考以下指标:总资产收益率(ROA)、净资产收益率(ROE)、销售毛利率、主营业务收入、资产负债率、每股收益、每股现金流等;

4)流动性因子

本基金考察的流动性因子可以参考以下指标:成交量、换手率、流通市值等。

本基金将依据经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面,定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度,采用定量的模式挑选最稳定有效的因子集合作为选股模型的判别因子,并依据投资目标,权衡风险与收益特征,构建定量选股模型。模型的使用以及因子的判定方法同样需要随着市场的变化根据不同的测试环境以及不同的测试结果进行动态的更新。

本基金利用"长信量化中小盘模型"选取最具投资价值的个股进入本基金的股票投资组合。

(3)股票投资组合的优化

本基金还将考察对行业及板块有影响的政策制度、对个股有影响的潜在事件等内容,从而对股票投资组合进行复核和优化,调整个股权重,在控制风险的前提下追求收益最大化。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中,将采用积极主动的投资策略,结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种,在兼顾收益的同时,有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上,本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素,对个券进行积极的管理。

4、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。

(1)权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险,有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究,并结合期权定价模型,评估权证的合理投资价值,在有效控制风险的前提下进行权证投资;

本基金将通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略,杠杆交易策略等,利用权证进行对冲和套利等。

(2)资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析,形成对资产证券的风险和收益进行综合评估,同时依据资产支持证券的定价模型,确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上,本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率,对资产支持证券进行跟踪和测评,从而形成有效的风险评估和控制。

(3)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

九、基金的业绩比较基准

1、本基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为中证700指数,债券投资部分的业绩比较基准为中证综合债指数,本基金的业绩比较基准为复合指数:

中证700指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%

若今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数,导致本业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告。

2、选择业绩比较基准的理由

中证700 指数是中证指数有限公司研发的系列规模指数体系中的中小盘指数,样本股是由中证500和中证200样本股组成的700只股票,用以反映市场上中小盘股的整体表现。由于本基金的定位是专注于中小盘股的投资,因此,选择中证700 指数作为业绩基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,因此该指数是本基金较为切合的市场基准选择。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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2018年6月30日(摘自本基金2018年2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	767,231,918.47	89.10
	其中:股票	767,231,918.47	89.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,406,952.00	1.21
	其中:债券	10,406,952.00	1.21
	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	73,588,346.23	8.55
8	其他资产	9,896,786.84	1.15
9	合计	861,124,003.54	100.00

注:本基金本报告期末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	545,267,396.82	64.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,011,973.07	5.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,532,457.63	3.86
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	106,865,708.96	12.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,662,379.84	1.26
L	租赁和商务服务业	4,826,242.53	0.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,054,941.33	1.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,010,818.29	1.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	767,231,918.47	90.92

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	000418	小天鹅A	240,054	16,647,744.90	1.97
2	600567	山鹰纸业	4,180,000	16,134,800.00	1.91
3	000661	长春高新	70,000	15,939,000.00	1.89
4	000528	柳　工	1,478,080	15,830,236.80	1.88
5	600681	百川能源	1,209,611	15,676,558.56	1.86
6	601100	恒立液压	741,268	15,477,675.84	1.83
7	600782	新钢股份	2,765,400	15,430,932.00	1.83
8	600845	宝信软件	579,652	15,273,830.20	1.81
9	300170	汉得信息	932,200	15,138,928.00	1.79
10	600346	恒力股份	1,030,000	15,099,800.00	1.79

(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	10,035,000.00	1.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	371,952.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,406,952.00	1.23

(五)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	130023	13附息国债23	100,000	10,035,000.00	1.19
2	128035	大族转债	3,240	371,952.00	0.04

(六)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序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股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十)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。

(十一)投资组合报告附注

1、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、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	476,946.84
2	应收证券清算款	8,632,771.34
3	应收股利	-
4	应收利息	287,815.04
5	应收申购款	499,253.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,896,786.84

4、报告期末持有的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不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

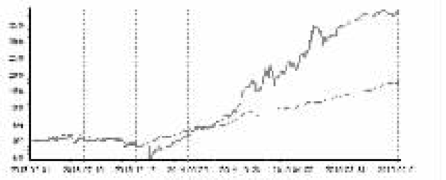
十二、基金的业绩

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:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效日(2015年2月4日-2015年12月31日)	42.40%	2.78%	20.57%	2.15%	21.83%	0.63%
2016年1月1日-2016年12月31日	3.76%	1.85%	-12.37%	1.36%	16.13%	0.49%
2017年1月1日-2017年12月31日	-14.22%	0.90%	2.61%	0.63%	-16.83%	0.27%
2018年1月1日-2018年3月31日	-3.79%	1.32%	-1.35%	1.04%	-2.44%	0.28%
2018年4月1日-2018年6月30日	-10.70%	1.47%	-9.86%	0.96%	-0.84%	0.51%

(二)自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、图示日期为2015年2月4日至2018年6月30日。

2、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

1、基金费用的种类

(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、律师费和诉讼费;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金的证券交易费用;

(7)基金的银行汇划费用;

(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。

2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

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,于次月前5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)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

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,于次月前5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、公休日等,支付日期顺延。

上述"(一)基金费用的种类中第3-8项费用",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,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)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;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用与计算公式

(1)场外申购费用

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。具体费率如下:

申购金额(M,含申购费)	前端申购费率
M＜100万	1.5%
100万≤M＜500万	1.0%
500万≤M	1000元每笔

注:M为申购金额

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。

(2)场内申购费用

投资者在场内申购本基金时缴纳申购费用。本基金的场内申购费率与上述规定的场外申购费率一致。

2、赎回费用

本基金的赎回费用在投资者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,场内、场外赎回具体费率如下:

持有时间(Y)	赎回费率
Y＜7天	1.5%
7天≤Y＜30天	0.75%
30天≤Y＜1年	0.5%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0%

注:Y为持有期限

对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产;对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费,其75%计入基金财产;对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费,其50%计入基金财产;对于持有期不少于6个月的基金份额所收取的赎回费,其25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

3、转换费用与计算方式

本公司已开通了长信量化中小盘股票基金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)、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)、长信纯债壹号债券基金A类份额(A类代码:519985)、长信量化先锋混合基金A类份额(A类代码:519983)、长信利丰债券基金C类份额(C类代码:519989)、长信双利优选混合基金、长信内需混合基金、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信恒利混合基金、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、长信上证港股通指数型发起式基金、长信先优债券基金、长信中证500指数基金、长信乐信混合基金、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金之间的双向转换业务。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》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,对原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"部分,对基金管理人主要人员情况进行了更新;

2、在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料;

3、在"五、相关服务机构"部分,更新了部分销售机构信息;

4、在"八、基金份额的申购与赎回"部分,更新可转换的基金信息;

5、在"十、基金投资组合报告"部分,更新了相应的内容;

6、在"十一、基金的业绩"部分,更新了相应内容,并经托管人复核;

7、在"二、释义"、"八、基金份额的申购与赎回"、"九、基金的投资"、"十三、基金资产估值"、"十七、基金的信息披露"、"十八、风险揭示"、"二十、基金合同的内容摘要"、"二十一、基金托管协议的内容摘要"等部分,更新了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关内容;

8、在"二十三、其它应披露的事项"部分,披露了本次更新以来涉及本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

二〇一八年九月十七日