# 长信利息收益开放式证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

2009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:中国农业银行股份有限公司

长信利息收益开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2003年12月25日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]149号文批准公开发行。本基金的基金合同于2004年3月19日正式生效。

**重要提示**

本基金于2003年12月25日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]149号文批准公开发行。本基金的基金合同于2004年3月19日正式生效。

长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”)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审核同意,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,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。本基金管理人不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资者投资于本基金时应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2009年9月19日,有关财务数据和净值表现自2009年1月1日至2009年6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 | 尹克文 |
| 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<br>(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人员情况

| 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。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。 |
| 胡运钊 | 董事 | 男 | 中共党员,研究生学历,高级经济师。曾任湖北省经委工业处处长、黄石市人民政府副市长、市委常委、常委副市长、湖北省人民政府副秘书长(正厅),办公厅主任、办公厅党组副书记。现任长江证券股份有限公司党委书记、董事长。 |
| 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,现任武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。 |
| 李国洪 | 董事 | 男 | 硕士,曾在武汉市人民政府工作。曾任长江证券有限责任公司投资银行总部副总经理、资产保全事业部总经理、办公室总经理。现任长江证券股份有限公司副总裁、合规总监。 |
| 徐文彬 | 董事 | 男 | 中共党员。曾任中国人民解放军273团政委,上海市松江区建设委员会党委书记,上海市松江区小昆山镇党委书记,上海市松江区泗泾镇党委书记。现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、总裁。 |
| 陈谋亮 | 董事 | 男 | 中共党员,硕士,高级经济师。曾任湖北经济学院讲师,杨子石化公司法律顾问,上海交大南洋股份有限公司部门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兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。现任上海海欣集团股份有限公司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、申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。 |
| 余秉立 | 独立董事 | 男 | 中共党员,本科,注册会计师。曾任武汉市财政局副科长、武汉市政府财贸办公室副科长、武汉市财政局副科长至副局长、武汉市审计局局长、党组书记、湖北省财政金融贸易办公室副主任、副书记、审计署驻武汉特派办特派员、书记、审计署驻武汉特派办正局级审计员。 |
| 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,武汉大学珞珈城市信用社副董事长,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 |
| 郭自祥 | 监事会主席 | 男 | 硕士,曾任武钢二钢厂宣传部部长、武钢工会副书记、副主席,武汉钢铁(集团)公司办公室主任。现任武汉钢铁集团公司企业管理部部长。 |
| 柳杨 | 监事 | 男 | 硕士,审计师,证券从业经历10年。曾任长江证券有限责任公司财务总部会计员、核算部经理、总经理助理,现任长江证券股份有限公司财务负责人、财务总部总经理。 |
| 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。 |
| 覃波 | 监事 | 男 | 中共党员,大学本科。曾任长江证券有限责任公司债券基金事业部市场部主管、长信基金管理有限责任公司市场开发部区域经理、营销策划部副总监、总经理助理兼市场开发部总监。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼专户理财部总监。 |
| 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。 |

注:上述人员之间均不存在近亲属关系

4、本基金基金经理

| 本基金基金经理情况 | | | |
|---|---|---|---|
| 姓名 | 职务 | 任职时间 | 简历 |
| 张文琍 | 基金经理 | 2005年11月26日至今 | 本科,中南财经大学金融专业毕业,具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理;2004年9月加入长信基金管理有限责任公司,历任长信利息收益基金交易员、基金经理助理职务,从2005年11月26日起至今担任本基金的基金经理。 |
| 徐力中 | 基金经理 | 2004年3月19日至2005年2月23日 | 曾于2004年3月19日至2005年2月23日期间担任本基金的基金经理。 |
| 李颖 | 基金经理 | 2005年2月23日至2005年11月26日 | 曾于2005年2月23日至2005年11月26日期间担任本基金的基金经理 |
| 王成 | 基金经理 | 2005年11月26日至2006年9月22日 | 曾于2005年11月26日至2006年9月22日期间担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 |
| 叶　琦 | 总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监 |
| 曾　芒 | 投资管理部总监、长信增利动态策略股票基金的基金经理、长信恒利优势股票基金的基金经理 |
| 李小羽 | 固定收益部总监、长信利丰债券基金的基金经理 |
| 骆泽斌 | 研究发展部总监 |

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、特定客户资产投资决策委员会、产品发展委员会等四个委员会 |
| 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 |
| 分支机构 | 北京分公司、武汉办事处 |
| 员工总数 | 99人(截至2009年9月19日) |

| 员工学历构成 | 学历 | 人数 | 占比 |
|---|---|---|---|
| | 博士 | 6人 | 6% |
| | 硕士 | 49人 | 50% |
| | 本科 | 36人 | 36% |
| | 专科 | 6人 | 6% |
| | 其它 | 2人 | 2% |
| | 总计 | 99人 | 100% |

**二、基金托管人**

(一)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:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

法定代表人:项俊波

成立日期:2009年1月15日

注册资本:2600亿元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68424199

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。

**三、相关服务机构**

(一)基金份额销售机构

| | |
|---|---|
| 1、直销机构: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:田丹 | 联系人:孙赵辉 |
| 电话:021-61009916 | 传真:021-61009917 |
| 客户服务专线:400-700-5566 | 公司网站:www.cxfund.com.cn |
| | |
| 2、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:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦 | |
| 法定代表人:项俊波 | 联系人:蒋浩 |
| 电话:010-85109219 | 传真:010-85109219 |
| 客户服务电话:95599 | 网址:www.abchina.com |
| | |
| (2)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一号长安兴融中心东楼四层 | |
| 法定代表人:郭树清 | |
| 客户服务电话:95533 | 网址:www.ccb.com |
| | |
| (3)交通银行股份有限公司 | |
| 注册地址:上海市仙霞路18号 | |
| 办公地址:上海市银城中路188号 | |
| 法定代表人:胡怀邦 | 联系人:陈洁 |
| 电话:021-58781234 | 传真:021-58408842 |
| 客户服务电话:95559 | 网址:www.95559.com.cn |
| | |
| (4)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:秦晓 | 联系人:王楠 |
| 电话:0755-83198888 | 传真:0755-83195109 |
| 客户服务电话:95555 | 网址:www.cmbchina.com |
| | |
| (5)中国民生银行股份有限公司 | |
| 注册地址:北京市东城区正义路4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:吴海鹏 |
| 电话:010-58351666 | 传真:010-83914283 |
| 客户服务电话:95568 | 网址:www.cmbc.com.cn |
| | |
| (6)中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:上海市常熟路171号 | |
| 法定代表人:丁国荣 | 联系人:邓寒冰 |
| 电话:021-54033888 | 传真:021-54035333 |
| 客户服务电话:021-962505 | 网址:www.sywg.com.cn |
| | |
| (7)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:胡运钊 | 联系人:李良 |
| 电话:021-68751929 | 传真:021-51062920 |
| 客户服务电话:400-8888-999或027-85808318 | 网址:www.95579.com |
| | |
| (8)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:上海市银城中路168号上海银行大厦29楼 | |
| 法人代表人:祝幼一 | 联系人:芮敏祺 |
| 电话:021-62580818-177 021-38676666 | 传真:(021)62583439 |
| 客户服务热线:400-8888-666 021-962588(上海地区) | 网址:www.gtja.com |
| | |
| (9)中国银河证券有限责任公司 | |
| 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:胡长生 | 联系人:李洋 |
| 电话:010-66568888 | 传真:010-66568532 |
| 客户服务电话:4008-888-888 | 网址:www.chinastock.com.cn |
| | |
| (10)湘财证券有限责任公司 | |
| 注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼 | |
| 办公地址:上海银城中路188号交银金融大厦 | |
| 法定代表人:陈学荣 | 联系人:杜颖灏 |
| 电话:021-68634518 | 传真:021-68865938 |
| 客户服务电话:400-888-1551 | 网址:www.xcsc.com |
| | |
| (11)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 95553 | 网址:www.htsec.com |
| | |
| (12)中信建投证券有限责任公司 | |
| 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:张佑君 | 联系人:权唐 |
| 电话:010-85130577 | 传真:010-65182261 |
| 客户服务电话:400-8888-108 | 网址:www.csc108.com |
| | |
| (13)兴业证券股份有限公司 | |
| 注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦 | |
| 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:谢高得 |
| 电话:021-38565785 | |
| 客户服务电话:400-8888-123 | 网址:www.xyzq.com.cn |
| | |
| (14)齐鲁证券有限责任公司 | |
| 注册地址:山东省济南市经十路128号 | |
| 办公地址:山东省济南市经十路128号 | |
| 法定代表人:李玮 | 联系人:傅咏梅 |
| 电话:0531-81283728、0531-81283731 | 传真:0531-81283735 |
| 客户服务电话:95538 | 网址:www.qlzq.com.cn |
| | |
| (15)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:王益明 | 联系人:吴宇 |
| 电话:021-63325888 | 传真:021-63327888 |
| 客户服务电话:95503 | 网址:www.dfzq.com.cn |
| | |
| (16)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:汤世生 | 联系人:李巍 |
| 电话:010-62294608 | 传真:010-62294608-6460 |
| 客户服务电话:0991-96562 010-62294600 | 网址:www.hysec.com |
| | |
| (17)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3楼 | |
| 法定代表人:唐双宁 | 联系人:刘晨、李芳芳 |
| 电话:021-22769081、021-22169089 | 传真:021-22169134 |
| 客户服务电话:4008-888-788、10108998 | 网址:www.ebscn.com |
| | |
| (18)西藏证券经纪有限责任公司 | |
| 注册地址:拉萨市罗布林卡路6号 | |
| 办公地址:上海市晖河路118号 | |
| 法定代表人:贾绍君 | 联系人:刘宇 |
| 电话:021-65526481 | 传真:021-65526481 |
| 客户服务电话:400-8811-177 | 网址:www.xzsec.com |
| | |
| (19)德邦证券有限责任公司 | |
| 注册地址:上海市普陀区曹杨路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:方加春 | 联系人:罗芳 |
| 电话:021-68761616 | 传真:021-68767981 |
| 客户服务电话:400-8888-128 | 网址:www.tebon.com.cn |
| | |
| (20)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:樊浩 |
| 电话:0086-25-84457777 | 传真:0086-25-84579763 |
| 客户服务电话:95597 | 网址:www.htsc.com.cn |
| | |
| (21)中国民族证券有限责任公司 | |
| 注册地址:北京市丰台区丰北路81号 | |
| 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:管宇 |
| 电话:010-59355974 | 传真:010-66553791 |
| 客户服务电话:40088-95618 | 网址:www.e5618.com |
| | |
| (22)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:徐世旺 |
| 电话:0451-82336863 | 传真:0451-82287211 |
| 客户服务电话:400-666-2288 | 网址:www.jhzq.com.cn |
| | |
| (23)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:俞江 |
| 电话:0755-82558305 | 传真:0755-28558355 |
| 客户服务电话:4008-001-001 | 网址:www.essence.com.cn |
| | |
| (24)江南证券有限责任公司 | |
| 注册地址:南昌市抚河北路291号 | |
| 办公地址:南昌市抚河北路291号 | |
| 法定代表人:姚江涛 | 联系人:俞雅娜 |
| 电话:0791-6768763 | 传真:0791-6789414 |
| 客户服务电话:400-8866-567 | 网址:www.scstock.com |
| | |
| (25)上海证券有限责任公司 | |
| 注册地址:上海市西藏中路336号 | |
| 办公地址:上海市西藏中路336号 | |
| 法定代表人:郁忠民 | 联系人:金艳 |
| 电话:021-53519888 | 传真:021-53519888 |
| 客户服务电话:021-962518 | 网址:www.962518.com |
| | |
| (26)华宝证券经纪有限责任公司 | |
| 注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层 | |
| 办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层 | |
| 法定代表人:陈林 | 联系人:楼斯佳 |
| 电话:021-50122222 | 传真:021-50122078 |
| 客户服务电话:021-38929908 | 网址:www.cnhhstock.com |

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 | 毕马威华振会计师事务所 |
| 注册地址 | 北京西城区金融大街27号投资广场23层 | 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 | 北京西城区金融大街27号投资广场23层 | 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 | 陈耀先 | 廖海(负责人) | 萧伟强 |
| 联系电话 | 010-58598839 | 021-51150298 | 021-22122888 |
| 传真 | 010-58598907 | 021-51150398 | 021-62881889 |
| 联系人 | 朱立元 | 廖海、吴军娥 | 彭成初(黄小熠、王国蓓为经办注册会计师) |

**四、基金的名称**

长信利息收益开放式证券投资基金

**五、基金的类型**

契约型开放式

**六、基金的投资目标**

本基金在尽可能保证基金财产安全和高流动性的基础上,追求超过银行存款的收益水平。

**七、基金的投资方向**

本基金投资对象主要包括:现金、一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单、剩余期限小于397天(含397天)的短期债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、中央银行票据、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金目前的投资对象主要包括银行存款、短期债券、中央银行票据、回购协议等,待获得监管部门的同意或许可后,本基金也将投资于大额存单、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或其他金融工具。

**八、基金的投资策略**

(一)决策依据

1、国家有关法律法规和《基金合同》的有关规定;

2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等;

3、国家财政政策、货币政策以及利率走势、通货膨胀预期等;

4、类别资产的预期收益率及风险水平。

(二)投资程序

本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1、研究发展部、固定收益部提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析等各类报告和投资建议,为投资运作提供决策支持;

2、投资决策委员会对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析,制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策;

3、基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下,拟定投资方案;

4、投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析,并形成决策;

5、基金经理根据投资决策在授权范围内构造具体的投资组合及操作方案,交由交易管理部执行;

6、金融工程部定期对基金投资组合进行绩效和风险评估,并提出风险控制意见;

7、基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

(三)投资组合管理的方法和标准

1、利率预期策略

通过对宏观经济、货币政策、短期资金供给等因素的分析,形成对利率走势的判断,并确定投资组合的平均剩余期限。

2、资产配置策略

根据对市场利率走势的判断,结合各品种之间流动性、收益性及风险情况,确定组合的资产配置,在保证组合高流动性、低风险的前提下尽量提升组合的收益。

3、无风险套利策略

由于市场分割,银行间市场与交易所市场的短期利率在一定时间可能存在定价偏离,同时在一定时间内市场也可能出现跨品种、跨期限套利机会。本基金将在充分论证套利的可行性基础上谨慎参与。

4、现金流预算管理策略

通过对未来现金流的预测,在投资组合的构建中,采取合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理,以满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上,将采用滚动投资策略,以提高基金财产的流动性。

**九、基金的业绩比较标准**

本基金业绩比较基准为:银行活期存款利率(税后)

**十、基金的风险收益特征**

基金为货币市场基金,其预期收益和风险水平低于债券型、混合型和股票型基金,属于证券投资基金产品中低风险的投资品种。

**十一、基金的投资组合报告**

本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合同规定,于2009年10月复核了本报告中的财务指标、收益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自2009年1月1日至2009年6月30日(摘自年半年度报告),本报告中所列财务数据未经会计师事务所审计。

1、报告期末基金资产组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 2,094,970,004.18 | 35.04 |
| | 其中:债券 | 2,094,970,004.18 | 35.04 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 198,200,497.30 | 3.31 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,498,758,246.89 | 58.52 |
| 4 | 其他资产 | 187,273,006.36 | 3.13 |
| 5 | 合计 | 5,979,201,754.73 | 100.00 |

2、报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 234,817,040,654.92 | 18.37 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 700,092,749.88 | 13.56 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:(1)报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

(2)报告期内货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况:不存在。

3、基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 66 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 128 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 48 |

注:报告期内投资组合平均剩余期限违规超过180天的情况:本报告期不存在。

(2)期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 75.73 | 13.56 |
| 2 | 30天(含)-60天 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 4.83 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 3.86 | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 8.35 | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 24.87 | - |
| 合计 | | 113.78 | 13.56 |

4、报告期末债券投资组合

(1)按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | 129,926,506.21 | 2.52 |
| 3 | 金融债券 | 410,239,468.10 | 7.94 |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,554,804,029.87 | 30.11 |
| 6 | 其他 | - | - |
| 7 | 合计 | 2,094,970,004.18 | 40.57 |
| 8 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 199,293,573.91 | 3.86 |

(2)基金投资前十名债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 0881267 | 06邯钢CP01 | 2,800,000 | 280,645,117.79 | 5.43 |
| 2 | 040705 | 04建行03浮 | 2,100,000 | 210,945,894.19 | 4.08 |
| 3 | 0881253 | 08陕有色CP02 | 2,000,000 | 200,473,655.69 | 3.88 |
| 4 | 050503 | 05工行03 | 2,000,000 | 199,293,573.91 | 3.86 |
| 5 | 0881241 | 08中电子CP02 | 1,300,000 | 130,410,826.75 | 2.53 |
| 6 | 0801081 | 08央行票据81 | 1,300,000 | 129,926,506.21 | 2.52 |
| 7 | 0981037 | 09鲁西CP01 | 900,000 | 90,006,284.94 | 1.74 |
| 8 | 0981093 | 09营口港CP01 | 800,000 | 80,015,557.44 | 1.55 |
| 9 | 0981100 | 09津药CP01 | 600,000 | 60,000,153.82 | 1.16 |
| 10 | 0981013 | 09贵航CP01 | 500,000 | 50,777,659.68 | 0.98 |

5、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况(%) |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 12 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2800 |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0534 |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1883 |

6、投资组合报告附注

(1)本基金采用摊余成本法计价。

(2)本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,本报告期内不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

(3)本报告期内没有需说明的证券投资决策程序,报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责、处罚。

(4)其他资产的构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 300,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 83,947,219.75 |
| 3 | 应收利息 | 24,447,167.42 |
| 4 | 应收申购款 | 78,578,619.19 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 187,273,006.36 |

**十二、基金的业绩**

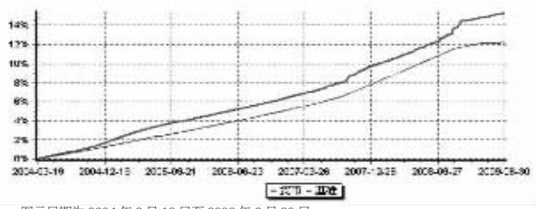
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现(截至2009年6月30日)

1、历史各时间段基金收益率与同期业绩比较基准收益率比较列表(2009年半年度报告数据):

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.1613% | 0.0040% | 0.0300% | 0.0000% | 0.1313% | 0.0040% |
| 过去三个月 | 0.4102% | 0.0034% | 0.0910% | 0.0000% | 0.3192% | 0.0034% |
| 过去六个月 | 0.7638% | 0.0030% | 0.5747% | 0.0026% | 0.1891% | 0.0004% |
| 过去一年 | 3.4312% | 0.0188% | 2.4112% | 0.0040% | 1.0200% | 0.0148% |
| 过去三年 | 9.5760% | 0.0121% | 8.2243% | 0.0031% | 1.3517% | 0.0090% |
| 自基金合同生效日起至今(2004年03月19日-2009年06月30日) | 15.3341% | 0.0094% | 12.2599% | 0.0027% | 3.0742% | 0.0067% |

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比:




图示日期为2004年3月19日至2009年6月30日

注:按基金合同规定,本基金自合同生效日起3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第十五条(八)投资限制的规定:

(1)投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;(2)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;(3)在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%;(4)投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的80%;(5)中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

本基金投资组合的平均剩余期限,不超过180天。

由于证券市场波动或投资组合处于调整过程中,造成基金在某一时间无法达到上述比例限制,本基金管理人将在10个交易日内积极调整基金投资组合,以达到上述比例限制。

**十三、费用概览**

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金的销售服务费;

(4)证