长信金利趋势股票型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：上海浦东发展银行股份有限公司

长信金利趋势股票型证券投资基金(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基金字[2005]168 号文批准公开发售。本基金的基金合同于 2006 年 4 月 30 日正式生效。本基金为股票型契约开放式基金。

重要提示

长信金利趋势股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2005 年 10 月 11 日中国证券监督管理委员会证监基金字 [2005]168 号文核准募集。本基金基金合同于 2006 年 4 月 30 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，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，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2009 年 10 月 30 日，有关财务数据和净值表现自 2009 年 7 月 1 日至 2009 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。本基金托管人上海浦东发展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 （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、董事会成员

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。历任武汉钢铁（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。历任中国人民解放军 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，上海市松江区洞泾镇党委书记。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。历任湖北经济学院讲师，扬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、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。历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	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总监、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、经理层人员

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

本基金历任基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
许万国	基金经理	2008年 6 月 2 日至今	经济学硕士，具有基金从业资格。曾任蔚深证券研究部研究员、深圳市恒宝鼎投资有限公司证券投资部负责人、融通基金管理有限公司策略研究员、融通基金蓝筹成长基金经理助理。先后从事上市公司行业研究、策略研究、投资管理等工作。2007 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司投资管理部，任基金经理助理一职。2008 年 6 月起任本基金基金经理。
陆文俊	基金经理	2006年 7 月 6 日至 2008 年 6 月 12 日	曾任本基金基金经理。
梁晓军	基金经理	2006年 4 月 30 日至 2006 年 9 月 22 日	曾任本基金基金经理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

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 10 月 30 日）		
员工学历构成	学历	人数	占比
	博士	6人	6%
	硕士	48人	49%
	本科	37人	37%
	专科	6人	6%
	其它	2人	2%
	总计	99人	100%

二、基金托管人

名称：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

成立时间：1992 年 10 月 19 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：56.6135 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：朱萍

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行经过十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快的增长，各项经营指标在新兴股份制商业银行中处于领先水平。截止到 2009 年 6 月 30 日，全行总资产规模已达 16，194.83 亿元人民币，各项存款余额 12，344.56 亿元人民币，各项贷款余额 9，387.18 亿元人民币，实现净利润 67.81 亿元人民币，每股收益达 0.856 元。

上海浦东发展银行总行设资产托管部，资产托管部下设市场发展部、托管运作部、技术保障部、内控管理部四个职能部门，在深圳设立托管分部，现有员工 33 人。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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 9 楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 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：李芳菲
电话：010–68424199	传真：010－68297268
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 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)	
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：曹榕
电话：021–58781234	传真：021–58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
（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：万丽
电话：0755－83198888	传真：0755－83195049
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
（5）中国邮政储蓄银行有限责任公司	
注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号	
办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号	
法定代表人：刘安东	传真：010–66415194
客户服务电话：95580	网址：www.psbc.com
（6）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：徐伟、虞谷云
电话：021–61618888	传真：021–63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
（7）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：曾鸣
电话：0591–87839338	传真：0591–87841932
客户服务电话：95561	网址：www.cib.com.cn
（8）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：董云巍、吴海鹏
电话：010–58351666	传真：010－83914283
客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
（9）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：孔丹	联系人：黎珊
电话：010–65557018	
客户服务电话：95558	公司网址：bank.ecitic.com
（10）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：021–63219781	传真：021–51062920
客户服务电话：400–8888–999 或 027–85808318	网址：www.95579.com
（11）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
（12）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
（13）湘财证券有限责任公司	
注册地址：长沙市黄兴路 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
（14）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
（15）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：010–65186758	传真：010–65182261
客户服务电话：400–8888–108	网址：www.csc108.com
（16）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
（17）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
（18）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：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座	
法定代表人：汤世生	联系人：李巍
电话：010–62267799	传真：010–62296854
客户服务电话：0991–96562 010–62294600	网址：www.ehongyuan.com
（19）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
（20）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：上海市辉河路 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
（21）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 楼	
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38—45 楼	
法定代表人：宫少林	联系人：黄新波
电话：0755–82969223	传真：0755–82943121
客户服务电话：95565 400–8888–111	网址：www.newone.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：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
（23）华宝证券有限责任公司	
注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层	
办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层	
法定代表人：陈林	法定代表人：陈林
电话：021–50122222	电话：021–50122222
客户服务电话：4008209898	客户服务电话：4008209898
（24）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：上海市南京西路 1468 号 2 楼	
法定代表人：郁忠民	法定代表人：郁忠民
电话：021–53519888	电话：021–53519888
客户服务电话：962518	客户服务电话：962518
（25）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	法定代表人：赵大建
电话：010–59355974	电话：010–59355974
客户服务电话：400–889–5618	客户服务电话：400–889–5618
（26）江海证券有限责任公司	
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	法定代表人：孙名扬
电话：0451–82336863	电话：0451–82336863
客户服务电话：400–666–2288	客户服务电话：400–666–2288
（27）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	法定代表人：姚江涛
电话：0791–6768763	电话：0791–6768763
客户服务电话：400–8866–567	客户服务电话：400–8866–567
（28）安信证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 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	法定代表人：牛冠兴
电话：0755–82558305	电话：0755–82558305
客户服务电话：4008001001	客户服务电话：4008001001
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

长信金利趋势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

本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化三大中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。

七、基金的投资方向

本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化三大中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。

本基金投资的资产类别包括股票、债券和货币市场工具。其中，股票类资产包括上市公司流通股股票和其他具有股权性质的证券；债券类资产包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券等。

本基金投资于三类资产的比例范围为：股票类资产投资比例为 60–95%，债券类资产投资比例为 0–35%，货币市场工具投资比例为 5－15%。

八、基金的投资策略

本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析研究受益于中国趋势点的持续增长的上市公司证券，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。

九、基金的业绩比较基准

上证 A 股指数×70%＋中信标普国债指数×30%。

将来如有更合适的指数推出，可考虑变更为更合适的比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于预期收益和预期风险较高的基金品种。

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。

基金托管人上海浦东发展银行根据本基金合同规定，于 2009 年 10 月 20 日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止至 2009 年 9 月 30 日（摘自 2009 年第三季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）本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	7，113，038，596.38	85.52
	其中：股票	7，113，038，596.38	85.52
2	固定收益投资	414，645，000.00	4.99
	其中：债券	414，645，000.00	4.99
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	755，279，203.18	9.08
6	其他资产	34，228，761.00	0.41
7	合计	8，317，191，560.56	100.00

（二）股票投资组合

1、按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	759，567，391.98	9.16
C	制造业	2，067，380，563.34	24.93
C0	食品、饮料	377，504，160.40	4.55
C1	纺织、服装、皮毛	9，900	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	285，794，751.02	3.45
C4	石油、化学、塑胶、塑料	312，494，059.01	3.77
C5	电子	6，394，401.20	0.08
C6	金属、非金属	210，964，247.92	2.54
C7	机械、设备、仪表	726，191，004.36	8.76
C8	医药、生物制品	134，509，847.73	1.62
C99	其他制造业	13，518，191.70	0.16
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	367，560，281.75	4.43
H	批发和零售贸易	427，442，475.55	5.15
I	金融、保险业	3，030，442，655.92	36.54
J	房地产业	258，856，731.36	3.12
K	社会服务业	197，100，369.00	2.38
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	4，688，127.48	0.06
	合计	7，113，038，596.38	85.76

2、基金投资前十名股票明细

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	601328	交通银行	56，999，735	474，807，792.55	5.72
2	600036	招商银行	30，310，064	447，982，745.92	5.40
3	600016	民生银行	55，007，495	370，750，516.30	4.47
4	601088	中国神华	12，000，495	364，335，028.20	4.39
5	600030	中信证券	14，299，775	357，637，372.75	4.31
6	601318	中国平安	6，149，734	311，791，513.80	3.76
7	600570	恒生电子	22，252，101	310，416，808.95	3.74
8	000792	盐湖钾肥	5，999，887	297，774，391.81	3.59
9	601166	兴业银行	8，499，888	287，211，215.52	3.46
10	600963	岳阳纸业	33，583，402	285，794，751.02	3.45

（三）债券投资组合

1、按投资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	414，645，000.00	5.00
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	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	414，645，000.00	5.00

2、基金投资前五名债券明细：

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	0801044	08央行票据 44	2，500，000	259，125，000.00	3.12
2	0801047	08央行票据 47	1，500，000	155，520，000.00	1.88

（四）权证投资组合

本基金本报告期末持有权证。

（五）资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（六）报告附注

1、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也没有受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1，664，239.48
2	应收证券清算款	18，285，522.82
3	应收股利	5，516，865.88
4	应收利息	8，358，473.81
5	应收申购款	403，659.01
6	其他应收款	
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	34，228，761.00

4、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。

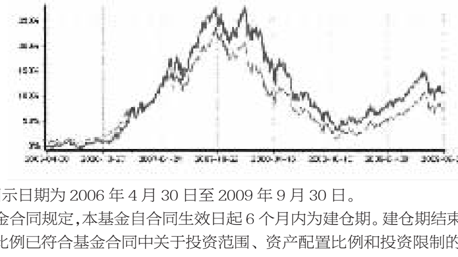
十二、基金的业绩

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。

2009 年一季度及历史各时间段本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

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
2006年 4 月 30 日至 2006 年 12 月 31 日	39.18%	1.45%	63.79%	1.15%	–24.61%	0.30%
2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	151.23%	2.12%	80.32%	1.94%	70.91%	0.18%
2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	–58.68%	2.47%	–58.63%	2.37%	–0.05%	0.10%
2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	51.70%	1.50%	47.59%	1.43%	4.11%	0.07%
2009年 7 月 1 日至 2009 年 9 月 30 日	–5.60%	2.00%	–5.07%	1.91%	–0.53%	0.09%

自合同生效之日（2006 年 4 月 30 日）至 2009 年 9 月 30 日期间，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比：



注：1、图示日期为 2006 年 4 月 30 日至 2009 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 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中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：股票类资产占资金资产总净值比例为 60–95%，债券类资产占资金资产总净值比例为 0–35%，货币市场工具占资金资产总净值比例为 5－15%。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的 1.5%年费率计提：

基金	管理费率（G%）
长信金利趋势基金	1.5%

管理费计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5‰的年费率计提：

基金	托管费率(T%)
长信金利趋势基金	0.25%

计算方法如下：

H=E×2.5‰÷当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

（1）投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（2）投资者选择交纳前端申购费用时，采用外扣法计算。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）	申购费率
M<100万元	1.5%
100万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万元	1000元

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。

上述前端申购费率为 2008 年 6 月 2 日开始的调整后的费率，详见 2008 年 5 月 20 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下股票基金交易手续费费率的公告》。

基金申购费用计算公式（前端收费模式）：

净申购金额＝申购金额 /（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额 / 申购当日基金份额净值

（3）投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间（N，年）	后端申购费率
N<1 年	1.5%
1年≤N<3 年	1.2%
3年≤N<5 年	0.8%
N≥5 年	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。

基金申购费用计算公式（后端收费模式）：

申购份额＝申购金额 /T 日基金份额净值

本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时，将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

本基金的申购费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可决定实际执行的申购费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

2、赎回费用

本基金根据投资者认（申）购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端认（申）购费用时，适用固定的赎回费率，定为 0.5%。

投资者选择交纳后端认（申）购费用时，适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间（N）	赎回费率
N≤2 年	0.5%
2年<N≤3 年	0.25%
N>3 年	0

基金赎回费用计算公式：

前端收费模式：

赎回总额＝赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

后端收费模式：

赎回总额＝赎回份额×T 日基金份额净值

后端申购（认购）费用＝赎回份额×申购日基金份额净值（基金份额面值）×后端申购（认购）费率

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－后端申购（认购）费用－赎回费用

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，扣除注册登记费和其他手续费后的余额为赎回费总额的 25%，归入基金财产。

本基金的赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限额内，基金管理人可决定实际执行的赎回费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

3、基金的转换费

本公司已开通了长信金利趋势股票基金与长信利息收益货币基金、长信银利精选股票基金、长信增利动态策略股票基金、长信双利优选混合基金、长信利丰债券基金之间实现双向转换。同时实行前端收费基金和前端收费互转，前后端收费基金不得互转。

（1）基金转换费由投资者承担，本基金的转换费率如下：

表：本基金管理人旗下基金[前端]转入长信双利[前端]与长信利丰转换费率表

	长信双利（转入）		长信利丰（转入）	
长信利息（转出）	M<100 万	1.50%	0.00%	
	100万≤M<500 万	1.00%		
	M≥500 万	1000元		
长信银利（转出）	N<2 年	0.50%	N<2 年	0.50%
	2≤N<3 年	0.25%	2≤N<3 年	0.25%
	N≥3 年	0	N≥3 年	0
长信金利（转出）	0.50%		0.50%	
长信增利（转出）	N<1 年	0.50%	N<1 年	0.50%
	1≤N<2 年	0.30%	1≤N<2 年	0.30%
	N≥2 年	0	N≥2 年	0
长信双利（转出）	—		N<1 年	0.50%
			1年≤N<2 年	0.20%
			2年≤N	0
长信利丰（转出）	M<100 万	1.60%	—	
	100万≤M<500 万	1.10%		
	M≥500 万	0.10%		

（注）N：持有年限，M：转出金额

表：本基金管理人旗下基金[前端]转入长信利息、银利、金利、增利转换费率表

	长信利息（转入）		长信银利（转入）		长信金利（转入）		长信增利（转入）	
长信利息（转出）	——		M<100 万	1.50%	M<100 万	1.50%	M<100 万	1.50%
			100 万≤M<500 万	1.00%	100万≤M<500 万	1.00%	100 万≤M<500 万	1.00%
			M≥500 万	1000元	M≥500 万	1000元	M≥500 万	1000元
长信银利（转出）	N<2年	0.50%			N<2年	0.50%	N<2年	0.50%
	2年≤N<3 年	0.25%			2年≤N<3 年	0.25%	2年≤N<3 年	0.25%
	3年≤N	0.00%			3年≤N	0	3年≤N	0
长信金利（转出）	0.50%		0.50%		——		0.50%	
长信增利（转出）	N<1年	0.50%	N<1年	0.50%	N<1年	0.50%		
	1年≤N<2 年	0.30%	1 年 ≤N<2 年	0.30%	1年≤N<2 年	0.30%		
	2年≤N	0	2年≤N	0	2年≤N	0		
长信双利（转出）	N<1 年	0.50%	N<1 年	0.50%	N<1 年	0.50%	N<1 年	0.50%
	1 年 ≤N <2 年	0.20%	1年≤N<2 年	0.20%	1年≤N<2 年	0.20%	1年≤N<2 年	0.20%
	2年≤N	0	2年≤N	0	2年≤N	0	2年≤N	0
长信利丰（转出）	0.10%		M<100 万	1.60%	M<100 万	1.60%	M<100 万	1.60%
			100万≤M<500 万	1.10%	100万≤M<500 万	1.10%	100万≤M<500 万	1.10%
			M≥500 万	0.10%	M≥500 万	0.10%	M≥500 万	0.10%

（注）N：持有年限，M：转出金额

（2）根据 2009 年 9 月 12 日临时公告《长信基金管理有限责任公司关于开通旗下基金转换业务的公告》，自 2009 年 9 月 16 日起在本公司直销机构及本公司旗下基金部分代销机构开通旗下六只开放式基金的相互转换业务，实行前端收费基金与前端收费互转，后端收费互转暂停。

（3）转换份额的计算公式：

转出金额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值

基金转换费＝转出金额×基金转换费率

转入金额＝转出金额－基金转换费

转入份额＝转入金额÷转入基金当日基金份额净值

（4）在法律法规规定的限制内，基金管理人可决定实际执行的转换业务模式，并在《招募说明书》中进行公告。本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时，将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书（《长信金利趋势开放式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“三、基金管理人”部分，主要人员情况中，更新了曾芒先生的职务；对内部组织结构和员工情况进行了更新；更新了基金管理人的内部控制制度；

2、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关业务经营情况；

3、在“五、相关服务机构”部分，增加和更新了代销机构的基本资料；

4、在“八、基金的申购、赎回与转换”部分，更新了基金的转换的内容；

5、在“十、基金的投资、十一、基金的业绩”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩；

6、在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新并完善了相应的服务；

7、在“二十三、其他应批露事项”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

2009 年 12 月 15 日