长信增利动态策略股票型证券投资基金招募说明书

基金管理人:长信基金管理有限责任公司　　基金托管人:中国民生银行股份有限公司

二〇〇六年九月

重要提示

本基金经2006年8月28日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180号文核准募集。

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。

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。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)和其他有关法律法规的规定,以及《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》(以下简称"合同"或"基金合同")编写。

本招募说明书阐述了长信增利动态策略股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由长信基金管理有限责任公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务关系的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文义另有所指,下列词语或简称代表如下含义:

招募说明书	指《长信增利动态策略股票型证券投资基金招募说明书》,即用于公开披露本基金管理人及托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的会计与审计、基金的信息披露、风险揭示、基金合同的变更、终止与基金财产的清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息,供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件,及其定期的更新
本合同、基金合同	指《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
中国	指中华人民共和国(仅为基金合同之目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方法规、地方政府规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指依据基金合同所募集的长信增利动态策略股票型证券投资基金
发售公告	指《长信增利动态策略股票型证券投资基金份额发售公告》
业务规则	指《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
基金管理人	指长信基金管理有限责任公司
基金托管人	指中国民生银行股份有限公司
基金代销机构	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司
基金合同当事人	指受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中华人民共和国境内注册登记或经政府有关部门批准设立的法人、社会团体和其他组织、机构
合格境外机构投资者	指符合法律法规规定的可投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的总称
基金合同生效日	指基金募集达到法律规定及基金合同约定的备案条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日
募集期	指自基金份额发售之日起不超过3个月的期间
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所正常交易日
开放日	指销售机构办理本基金申购、赎回等业务的工作日
T日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n日	指自T日起第n个工作日(不包含T日)
认购	指在本基金募集期内投资者购买本基金份额的行为
申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的申购自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理
赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理
巨额赎回	本基金单个开放日基金净赎回申请(净赎回申请=赎回申请总数+基金转换中转出申请份额总数-申购申请总数-基金转换中转入申请份额总数)超过上一日基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
销售服务费	指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用,该笔费用从基金财产中扣除,属于基金的营运费用
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	指基金份额持有人按基金合同和招募说明书的规定向基金管理人申请将其持有的基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的任一开放式基金(转出基金)的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金(转入基金)的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
基金资产总值	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能抗拒、不能避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的,使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:长信基金管理有限责任公司

住所:上海市浦东新区世纪大道1600号浦项商务广场16楼

办公地址:上海市黄浦区汉口路130号3-4楼

设立日期:2003年4月28日

注册资本:1亿元人民币

法定代表人:田玢

电话:021-63212222

传真:021-63217686

联系人:李毅

股权结构:长江证券有限责任公司出资4900万元人民币,占注册资本的49%;上海海欣集团股份有限公司出资3433万元人民币,占注册资本的34.33%;武汉钢铁股份有限公司出资1667万元人民币,占注册资本的16.67%;

股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会。公司实行董事会领导下的总经理负责制,总经理和副总经理组成公司的经营管理层。根据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和投资决策委员会等两个非常设委员会,以及金融工程部、投资管理部、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、综合行政部等九个职能部门,并根据公司发展需要设北京分公司。

公司现有员工56人,其中:博士学历5人,占8.96%;硕士学历24人占42.9%;本科学历19人,占33.9%;专科学历8人,占14.3%。具有海外留学或工作经历的6人,占10.7%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

董事长田丹先生,48岁,中共党员,硕士,经济师。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公司董事长。

董事叶烨先生,41岁,中共党员,博士。1993年进入证券行业,12年金融证券行业经验。先后在君安证券、国泰君安证券从事投资银行、营业部管理业务。曾任国泰君安证券资产管理总部总监。现任长信基金管理有限责任公司总经理。

董事胡运钊先生,58岁,中共党员,硕士。曾任湖北省经委处长,黄石市副市长、市委常委委员、常务副市场,湖北省政府副秘书长、办公厅主任,现任长江证券有限责任公司党委书记。

董事袁永林先生,57岁,中共党员,大专。曾任松江县泗联公社建筑站党委书记,松江县洞泾乡毛纺厂厂长、党支部书记,松江县洞泾乡工业公司经理、党支部书记,上海海欣有限公司副董事长、总经理,现任上海海欣集团股份有限公司副董事长、总经理。

董事王岑先生,57岁,中共党员,硕士,高级工程师。曾任武汉钢铁(集团)公司硅钢片厂计划员、科长、车间主任,武汉钢铁(集团)公司热轧厂热轧车间副主任、武汉钢铁(集团)公司总经理助理、武汉钢铁(集团)公司副总经理、武汉钢铁有限责任公司党委书记、副总经理,现任武汉钢铁(集团)公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。

董事沈岩先生,42岁,中共党员,硕士。曾任正大联合企业管理顾问公司企业顾问、上海海欣集团股份有限公司总裁助理,现任上海海欣集团股份有限公司副总经理。

董事李国洪先生,45岁,本科,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,现任长江证券有限责任公司副总裁。

独立董事朱恒先生,58岁,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。

独立董事余秉立先生,55岁,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,现任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。

独立董事黄宪先生,52岁,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,武汉大学路珈城市信用社副董事长,中港合资武新公司财务总经理。

独立董事宋晓燕女士,34岁,中共党员,博士。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师。

2、监事会成员

监事郭自祥先生,51岁,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,现任武汉钢铁股份有限公司总经理办公室主任。

监事柳扬先生,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,现任长江证券有限责任公司财务总部总经理。

监事王罗洁女士,50岁,本科,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,现任上海海欣股份有限公司财务总监。

监事覃波先生,32岁,中共党员,本科,证券、基金从业经历9年。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,现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场开发部总监。

监事李超先生,37岁,中共党员,大学本科,证券从业经历11年。曾任三峡证券有限责任公司稽核部稽核员、稽核主管、上海总部财务经理、稽核总部副总经理,亚洲证券有限责任公司稽核总部副总经理、合规部总经理。2004年7月加入长信基金管理有限责任公司,现任职于公司市场开发部。

3、经理层成员

总经理叶烨先生,(简历请参见董事会成员)

4、督察长

周永刚先生,硕士,经济师。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。

5、基金经理

曾芒先生,35岁,经济学博士。2005年获得中南财经政法大学政治经济学博士学位,通过基金从业资格考试。曾就职于上海海通证券公司武汉营业部、上海智盛企业管理咨询有限公司、南京智昊投资管理有限公司、武汉华正投资顾问有限公司,先后从事自营、证券投资管理、企业研究等工作,有较丰富的证券投资管理经验和良好的投资管理业绩。2005年7月加入长信基金管理有限责任公司投资管理总部,现拟任本基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

叶烨先生,长信基金管理有限责任公司总经理。

张大军先生,长信基金管理有限责任公司投资管理总部总监兼长信银利精选基金基金经理。

李小羽先生,长信基金管理有限责任公司固定收益部总监。

骆泽斌先生,长信基金管理有限责任公司研究部总监。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托取得基金代销业务资格的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制基金季度、半年度和年度报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

9、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、法律法规和基金合同规定的其他职责。

(四)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反上述法律法规的行为发生;

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生:

(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反法律法规、基金合同或托管协议;

(3)故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监督;

(6)玩忽职守、滥用职权;

(7)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(8)除按基金管理人制度进行基金证券投资外,直接或间接进行其他股票投资;

(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

(10)违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(11)贬低同行以抬高自己;

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(13)以不正当手段谋求业务发展;

(14)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(15)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

(1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2)不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(4)不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五)基金管理人的风险管理和内部控制制度

基金管理人高度重视内部风险控制,建立了完善的风险管理体系和控制体系,从制度上保障本基金的规范运作。

1、内部风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险以及不可抗力风险。

针对上述各种风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体程序,具体包括以下内容:

(1)	投资风险管理;
(2)	交易风险管理;
(3)	巨额赎回风险管理;
(4)	基金注册登记风险管理;
(5)	基金核算风险管理;
(6)	市场开发风险管理;
(7)	信息披露风险管理;
(8)	不可抗力风险管理。

2、内部控制制度的建立情况

建立健全基金管理公司的规章制度是基金管理公司的基础性工作,也是保护基金份额持有人的重要措施。除《公司章程》外,基金管理人还制定了以下制度:

(1)内部控制制度遵循的原则

合法合规性原则:公司内部控制制度应当符合国家法律法规、规章和各项规定。

全面性原则:内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节,并普遍适用于公司每一位员工。

有效性原则:通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行,内部控制制度应当具有高度的权威性,任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

独立性原则:公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位,各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司自有资产、基金资产和其他资产的运作应当分离。

相互制约原则:公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

防火墙原则:公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应当制定严格的审批程序和监管措施。

审慎性原则:制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则:内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

保持与业务发展的同等地位原则:公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上,内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

定性和定量相结合原则:建立完备风险控制指标体系,使风险控制更具客观性和操作性。

(2)内部控制制度的内容

基金管理人的内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

(3)内部风险控制体系结构

公司董事会、经营管理层、内部控制委员会、督察长、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

a、董事会:全面负责公司的风险控制工作,对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任;

b、经营管理层:负责日常经营管理中的风险控制工作,对内部控制制度的有效执行承担责任;

c、内部控制委员会:协助经营管理层负责公司风险控制工作,主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度,协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部总监、基金事务部总监、市场开发部总监和部分从事内部控制方面的业务骨干组成;

d、督察长:负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查,并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价;

e、监察稽核部:负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况;对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核;对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查,并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责;

f、业务部门:根据公司各项基本管理制度,结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则,加强对各项业务和各业务环节的风险控制;

g、公司各岗位:根据岗位职责和业务操作流程,按业务授权规范操作,严格控制操作风险。

(4)风险管理和内部控制的措施

a、建立内控结构,完善内控制度:建立、健全了行之有效的内控制度,确保各项业务活动都有适当的授权和明确的分工,确保监察稽核活动的独立性、权威性;

b、建立相互分离、相互制衡的内控机制:建立了明确的岗位分离制度,做到研究、决策分开,基金交易集中,形成不同部门,不同岗位之间的制衡机制,同时进行空间隔离,建立防火墙,充分保证信息的隔离和保密,从制度上降低和防范风险;

c、建立、健全岗位责任制:建立、健全了岗位责任制,使每位员工都明确自己的任务、职责,及时上报各自工作领域中发现的风险隐患,以防范和化解风险;

d、建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序:建立了内部控制委员会及其风险评估小组,使用适合的程序和方法,确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险;建立自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度做出决策,减少风险造成的损失;

e、建立有效的内部监控系统:建立了足够、有效的内部监控系统,如计算机预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控;

f、使用数量化的风险管理手段:采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失;

g、提供足够的培训:制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,不断提高员工素质和职业技能,防范和化解风险。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1)基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

(2)基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

四、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")

住所: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:经叔平

成立时间:1996年2月7日

基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号

组织形式:股份有限公司(上市)

注册资本:2,586,721,300元人民币

存续期间:持续经营

电话:010-58560758,58560666-8988

联系人:辛洁 吴杰

(二)主要人员情况

中国民生银行基金托管部共有员工8人,平均年龄35岁,100%员工拥有大学本科以上学历,70%以上员工取得基金从业资格。

(三)基金托管业务情况

中国民生银行于2004年7月9日获得基金托管资格,目前已经托管4只开放式证券投资基金,截至2006年3月31日,民生银行托管的资金规模总计为32.738亿元人民币。

(四)基金托管人的内部控制情况

1、内部风险控制目标

强化内部管理,保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行,保证自觉合规依法经营,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系,保障业务正常运行,维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2、内部风险控制组织结构

中国民生银行基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行稽核监察部、基金托管部内设风险控制处及基金托管部各业务处室共同组成。总行稽核部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。基金托管部内设独立、专职的内部监督稽核处,负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划,组织、指导、协调、监督各业务处室风险控制工作的实施。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则:基金托管部设立独立的风险控制处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4、内部风险控制制度和措施

(1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估:监督稽核处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

(下转B14版)

长信增利动态策略股票型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司　　基金托管人:中国民生银行股份有限公司

个人投资者投资理财服务热线:021-33074848　　机构投资者投资理财服务热线:021-63218187、63217997

重要提示

1、长信增利动态策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180号文核准。

2、本基金是契约型开放式证券投资基金。

3、本基金的管理人为长信基金管理有限责任公司(以下简称"本公司"),托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行"),基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中登")。

4、本基金将自2006年9月18日起至2006年11月3日止,通过本公司的直销网点、民生银行及代销券商的代销网点公开销售。

5、本基金募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者。个人投资者指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的自然人;机构投资者指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准设立的法人、社会团体和其他组织、机构;合格境外机构投资者是指符合法律法规规定的可投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者。

6、投资者认购本基金,需使用上海证券交易所普通股票账户(或证券投资基金账户)开立为中登开放式基金账户。办理开立开放式基金账户业务的机构包括但不限于本基金的直销中心和各代销机构下属代销网点。

7、投资者在申请开立基金账户时应指定一个银行账户为其结算账户(或称"资金交收账户"),用于该投资者的基金赎回、分红和退款等资金结算。该账户的户名应与投资者开立的基金账户名称相同。

8、销售机构(指本公司的直销中心和各代销机构下属代销网点)对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受了认购申请。申请的成功与否应以基金管理人通过基金注册登记机构发送的确认结果为准。投资者可在基金合同生效后到原认购网点查询成交确认情况。

9、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请阅读2006年9月15日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》上的《长信增利动态策略股票型证券投资基金招募说明书》。

10、本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.cxfund.com.cn)、民生银行网站(www.cmbc.com.cn)。

11、募集期内,本基金根据需要可能新增代销机构,请留意本公司及各代销机构的公告或拨打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

12、投资者所在地若未开设销售网点,请拨打本公司的直销专线电话021-63218187、63217997或客户服务电话021-33074848咨询认购事宜。

13、本公司可根据募集期间的具体情况对基金份额发售事宜做适当调整。

一、基金募集的基本情况

(一)基金名称

长信增利动态策略股票型证券投资基金

(二)基金类型

股票型证券投资基金

(三)运作方式

契约型开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额面值

每份基金份额面值为1.00元

(六)发售对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者。

(七)基金代码

认购期基金代码:521992(后端),521993(前端)。

(八)销售机构

1、直销机构:长信基金管理有限责任公司

对于在上海和北京的投资者,如果在上海直销中心或在北京分公司认购金额100万元人民币以上,直销机构将提供上门咨询和接单服务;对于不在上海和北京的投资者,如果认购金额在500万元人民币以上,直销机构提供上门咨询和接单服务。

2、代销银行:民生银行

3、其他代销机构:

(1)长江证券

长江证券以下27个城市的52家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

北京、天津、哈尔滨、齐齐哈尔、沈阳、大连、青岛、上海、深圳、广州、福州、厦门、佛山、武汉、郑州、乌鲁木齐、荆州、十堰、黄石、宜昌、荆门、仙桃、重庆、成都、西安、南京、杭州。(如有变化请以当地长江证券网点公告为准)

在募集期间,投资者可以拨打长江证券客户服务热线:4008-888-999,或按打各城市营业网点咨询电话,或访问长江证券网址:www.cz318.com.cn。

(2)国泰君安证券

国泰君安以下98个城市的160家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

北京、通州、怀柔、天津、石家庄、太原、晋城、呼和浩特、济源、赤峰、沈阳、大连、长春、吉林、桦甸、舒兰、哈尔滨、齐齐哈尔、深圳、平湖、广州、汕头、顺德、海口、琼海、儋州、福州、闽清、永泰、厦门、泉州、南宁、南昌、九江、庐山、浮阳、鹰潭、余江、贵溪市、宜春、萍乡、高安、抚州、南丰、上海、南京、无锡、溧水、常州、徐州、邳州、杭州、宁波、绍兴、衢州、台州、天台、仙居、合肥、济南、临沂、青岛、郑州、荥阳、武汉、荆州、襄樊、宜昌、长沙、常德、桃源、衡阳、衡阳县、株洲、株洲县、成都、金堂、泸州、纳溪、贵阳、清镇、昆明、丽江、个旧、芒市、文山、重庆、石柱、华岩、奉节、巫山、西安、兰州、敦煌市、嘉峪关、酒泉、张掖、乌鲁木齐。(如有变化请以当地国泰君安网点公告为准)

在募集期间,投资者可以拨打国泰君安客户服务热线:400-8888-666,或按打各城市营业网点咨询电话,或访问国泰君安网址:www.gtja.com。

(3)中国银河证券

银河证券以下61个城市的167家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

北京、天津、石家庄、秦皇岛、太原、晋中、临汾、呼和浩特、包头、沈阳、长春、哈尔滨、上海、南京、扬州、苏州、杭州、嘉兴、绍兴、湖州、德清、金华、兰溪、台州、温州、丽水、合肥、马鞍山、福州、南昌、烟台、郑州、武汉、襄樊、宜昌、荆门、长沙、广州、佛山、顺德、汕头、湛江、中山、廉江、南宁、海口、重庆、江津、成都、昆明、西安、兰州、西宁、乌鲁木齐、大连、宁波、厦门、青岛、济南、深圳、东莞。(如有变化请以当地银河证券网点公告为准)

在募集期间,投资者可以拨打银河证券客户服务热线:010-68016655,或按打各城市营业网点咨询电话,或访问银河证券网址:www.chinastock.com.cn。

(4)广发证券

广发证券以下63个城市的132家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

广州、北京、武汉、济南、烟台、青岛、郑州、天津、长春、太原、上海、杭州、宁波、无锡、南京、绍兴、南通、深圳、海口、珠海、汕头、佛山、中山、湛江、昆明、重庆、成都、南宁、兰州、西安、福州、厦门、顺德、东莞、肇庆、清远、惠州、梅州、台山、韶关、普宁、南海、高明、南海、开平、新会、江门、罗定、云浮、南雄、英德、连州、高要、廉江、锦州、辽阳、温州、漳州、福清、莆田、宁德、东泉、泉州、东营

在募集期间,投资者可以拨打广发证券客户服务热线:020-87555888*875,或按打各城市营业网点咨询电话,或访问广发证券网址:www.gf.com.cn。

(5)光大证券

光大证券在以下30个城市的46个营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:北京、天津、哈尔滨、黑河、大庆、齐齐哈尔、长春、上海、深圳、福州、佛山、江门、武汉、长沙、东莞、惠州、海口、顺德、广州、南宁、湛江、重庆、成都、遵义、内江、乌鲁木齐、昆明、西安、南京、丹阳。

在募集期间,投资者可以拨打光大证券客户服务热线:021-68816770,或拨打各城市营业网点咨询电话。

公司网址:www.ebscn.com

(6)招商证券

招商证券以下19个城市的31家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

北京、上海、南京、杭州、无锡、武汉、广州、哈尔滨、成都、扬州、东莞、珠海、昆明、南宁、佛山、长沙、合肥、福州、深圳。(如有变化请以当地招商证券网点公告为准)

在募集期间,投资者可以拨打招商证券客户服务热线:400-8888-111,0755-82943511,0755-26951111,或按打各城市营业网点咨询电话,或访问招商证券网址:www.newone.com.cn。

(7)中信建投证券

中信建投证券以下69个城市的123家营业网点对投资者办理开户和认购业务:

北京、上海、天津、重庆、深圳、广州、南海、清远、潮州、揭阳、海口、沈阳、大连、鞍山、锦州、长春、大安、哈尔滨、阿城、武汉、黄石、荆州、宜昌、襄樊、老河口、十堰、长沙、株洲、张家界、上饶、郴州、贵阳、成都、邛崃、简阳、泸州、广元、涪陵、綦江、合川、黔江、南京、江宁、常州、泰州、兴化、苏州、连云港、杭州、宁波、福州、福清、厦门、南昌、吉安、赣州、瑞金