长信利息收益开放式证券投资基金更新招募说明书摘要

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

2007年第【1】号

一、基金合同的生效日期

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。

二、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。

本更新招募说明书摘要根据基金合同编写,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》、《运作办法》、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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2007年2月28日,有关财务数据和净值表现自2006年10月1日至2006年12月31日(财务数据未经审计)。

三、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

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

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

法定代表人:田丹

总经理:叶烨

电话:021-63212222

传真:021-63217686

联系人:李毅

(二)主要人员情况

1、董事会成员

董事长田丹先生,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。现任本公司董事长。

董事叶烨先生,中共党员,硕士。历任交通部秦皇岛港务局计划处科员,君安证券有限公司投资银行部高级经理、营业部总经理、公司副总裁,国泰君安证券股份有限公司北京分公司副总经理、武汉分公司总经理、资产管理总部总监。现任本公司总经理。

董事胡运钊先生,中共党员,经济管理学硕士,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。现任湖北省人民政府副秘书长(正厅)、办公厅党组副书记、长江证券党委书记、董事长。

董事袁永林先生,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。

董事王岭先生,中共党员,硕士,高级经济师。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。

董事沈岩先生,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,硕士,曾在武汉市人民政府工作。历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,中共党员,大学本科,高级经济师。历任中国人民银行、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,中共党员,大学本科,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,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。

独立董事宋晓燕女士,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师。

2、监事会成员

监事郭自祥先生,中共党员,硕士,政工师。曾任江汉油田新村农场干部,武钢二炼钢厂宣传部副部长、部长、连铸车间主任,武钢工会副书记、副主席,武汉钢铁(集团)公司钢铁公司办公室主任,现任武汉钢铁股份有限公司总经理办公室主任。

监事柳杨先生,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、副总经理,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,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,中共党员,大学本科,证券从业经历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、市场开发部总监。

监事李超先生,中共党员,大学本科,证券从业经历10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、长信基金公司监察稽核部副总监,现任长信基金管理有限责任公司市场开发部。

3、经理层成员

叶烨先生,总经理。简历见董事会成员。

蒋学杰先生,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。现任长信基金管理有限责任公司副总经理。

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、本基金基金经理

张文琍女士,本科,证券从业经历12年。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,现任本基金基金经理。

6、投资决策委员会成员

叶烨先生,董事,总经理;

蒋学杰,副总经理;

李小羽先生,固定收益部总监;

骆泽斌先生,研究发展部总监。

7、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

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、副总经理及督察长组成公司的经营管理层。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委员会,以及金融工程部、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、综合行政部等十个职能部门,并根据公司发展需要设北京分公司。

公司现有员工59人,其中:博士学历4人,占7%;硕士学历28人占48%;本科学历19人,占32%;专科学历6人,占10%。具有海外留学或工作经历的6人,占10.17%。

四、基金托管人

(一)基金托管人概况

基金托管人:中国农业银行

法定代表人:杨明生

注册资金:361亿元人民币

住所:北京市海淀区复兴路甲23号

办公地址:北京市西三环北路100 号金玉大厦

组织形式:国有独资企业

营业期限:持续经营

(二)主要人员情况

杨明生先生:中国农业银行党委书记、行长。硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任,农行沈阳市分行副行长、党组成员,农行工业信贷部主任助理、副主任、主任,农行天津市分行副行长、党组副书记(主持工作),农行天津市分行行长、党组书记,农行副行长、党委副书记。现任农行党委书记、行长。

杨琨先生:中国农业银行副行长。硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长,农行人事教育部副主任,农行市场开发部总经理,农行安徽省分行行长、党委书记。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生:基金托管部总经理。博士,高级经济师,曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理,农行总行法律事务部副总经理、总经理。现任基金托管部总经理。

刘树军先生:基金托管部副总经理。工商管理硕士,高级经济师、高级记者。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长。现任基金托管部副总经理。

余晓晨先生:托管业务部副总经理。经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长,现任托管业务部副总经理。

(三)证券投资基金托管业务情况

1、部门设置及员工:1998年5月,中国农业银行证券投资基金托管部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、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统,现有员工79名。

(2)基金托管业务经营情况

截止2006年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共48只,基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长二号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金,托管基金份额达892.29亿份。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:

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

法定代表人:田丹

总经理:叶烨

直销电话:021-63217535

联系人:孙赵辉

2、代销机构:

(1)中国农业银行

注册地址:北京市海淀区复兴路甲23号

法定代表人:杨明生

电话:010-68297268

传真:010-68297268

联系人:蒋浩

(2)长江证券有限责任公司

注册地址:武汉市新华下路特8号

法定代表人:胡运钊

电话:021-63296362

传真:021-33130730

联系人:甘露

(3)中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝内大街188号中信建投证券

法定代表人:张佑君

电话:(010)65186758;

传真:(010)65182261

联系人:权唐

客户服务电话:400-8888-108(免长途费);(010)65186758

(4)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

法人代表人:祝幼一

电话:(021)62580818-177

传真:(021)62583439

联系人:芮敏祺

客户服务热线:400-8888-666　021-962588(上海地区)

(5)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

联系人:杨盛芳

联系电话:021-68419974

传真:0591-7541476

(6)天同证券有限责任公司

注册地址:山东济南泉城路180 号齐鲁国际大厦五层

法定代表人:段虎

电话:0531-5689690

传真:0531-5689900

联系人:罗海涛

(7)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

法定代表人:陈学荣

电话:021-68634518

传真:021-68865938

联系人:杜颖灏

客服电话:021-68865020

(8)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

法定代表人:朱利

电话: 010-66568888

传真:010-66568532

联系人:郭京华

客户服务热线:010-68016655

(9)海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:021-53858553

联系人:金芸

客服电话:021-962503或拨打各城市营业网点咨询电话

(10)华泰证券有限责任公司

地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:025-84457777-882、721

联系人:张雪瑾、袁红彬

客户咨询电话:025-84579897

(11)广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人:王志伟

联系人:肖中梅

开放式基金咨询电话:(020)87555888转各营业网点

开放式基金业务传真:(020)87557985

(12)天相投资顾问有限公司

注册地址:中国北京市朝阳区幸福村中路锦绣园D座

法定代表人:林义相

电话::(010)84533131

(13) 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: 蒋超良

电话: (021)58781234

传真: (021)58408842

联系人: 王玮

客户服务电话: 95559

(14)申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

法定代表人:王明权

联系电话:(021)54033888

联系人;胡洁静

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)注册登记机构:

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:陈耀先

电话:0755-82084015

传真:0755-82084010

联系人:刘玉生

(三)出具律师意见书的律师事务所:

名称:上海源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

法定代表人:廖海

电话:021-51150298

传真:021-51150398

联系人:田卫红

经办律师:廖海、田卫红

(四)审计基金财产的会计师事务所:

名称:毕马威华振会计师事务所

住所:北京东长安街1 号东方广场东2 座8 层

办公地址:上海市静安区南京西路1266号49-51楼

法定代表人:何潮晖

联系人:黎俊文

经办注册会计师:王国蓓　许卓炎

电话:021-22122888

传真:021-62881889

六、基金的名称

长信利息收益开放式证券投资基金

七、基金的类型

契约型开放式

八、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。

九、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。

十、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、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、内部控制委员会和风险与绩效评估小组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中也可能出现跨品种、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。

十一、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为:一年期存款税后利息率

十二、基金的风险收益特征

本基金投资于短期资金市场基础工具,由于这些金融工具的特点,因此整个基金的风险于各种风险因素的暴露之中,包括政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险和特殊风险等等。

十三、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根据本基金合同规定,于2007年3月19日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2006年1月1日至2006年12月31日(摘自2006年年度报告)本报告中所列财务数据经会计师事务所审计。

(一)报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	2,572,993,428.64	59.24%
买入返售证券	1,617,650,000.00	37.25%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	5,828,589.60	0.13%
其中:商业银行协议存款	0.00	0.00%
其他资产	146,708,227.40	3.38%
合计	4,343,180,245.64	100.00%

(二)报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	423, 705, 865, 000.00	10.63%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	219,000,600.00	5.34%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

注:(1)报告期内债券回购融资余额应取报告期内每日融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每日融资余额占基金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。

(三)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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	169
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

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	28.29%	5.34%
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.10%	0.00%
2	30天(含)-60 天	12.47%	0.00%
3	60天(含)-90 天	37.76%	0.00%
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.22%	0.00%
4	90天(含)-180 天	5.40%	0.00%
5	180天(含)-397 天(含)	1.79%	0.00%
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	18.35%	0.00%
	合计	102.27%	5.34%

(四)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

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	458,813,003.18	11.18%
	其中:政策性金融债	222,182,743.06	5.41%
3	央行票据	926,309,953.88	22.58%
4	企业债券	1,187,870,471.58	28.95%
5	其他	0.00	0.00%
合计		2,572,993,428.64	62.71%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		332,949,435.76	8.11%

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		摊余成本(元)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	06央行票据 04	3,000,000.00	0.00	299,248,686.67	7.29%
2	06沪电气 CP01	2,000,000.00	0.00	200,378,186.36	4.88%
3	06央行票据 14	2,000,000.00	0.00	199,070,614.74	4.85%
4	06央行票据 12	2,000,000.00	0.00	199,063,715.09	4.85%
5	05中行 02	1,600,000.00	0.00	163,337,701.83	3.98%
6	04国开 17	1,600,000.00	0.00	162,421,155.74	3.96%
7	06武钢 CP01	1,100,000.00	0.00	107,087,430.19	2.61%
8	06央行票据 02	1,000,000.00	0.00	99,922,065.85	2.44%
9	05首都机场债	800,000.00	0.00	86,148,357.68	2.10%
10	06北建工 CP01	800,000.00	0.00	78,285,787.61	1.91%

(五)"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	10
报告期内偏离度的最高值	0.2159%
报告期内偏离度的最低值	-0.3392%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1271%

(六)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

序号	项目	金额(元)
1	交易保证金	300,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	18,390,954.03
4	应收申购款	128,017,273.37
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计		146,708,227.40

十四、基金的业绩

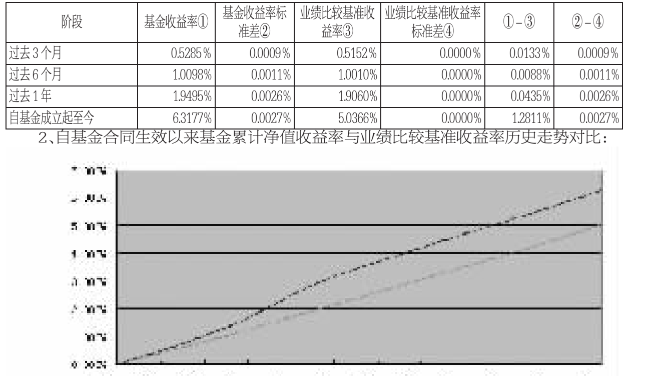
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现(自2006年1月1日至2006年12月31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(2006年年报数据):

阶段	基金收益率①	基金收益率标准差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3个月	0.5285%	0.0009%	0.5152%	0.0000%	0.0133%	0.0009%
过去6个月	1.0098%	0.0011%	1.0010%	0.0000%	0.0088%	0.0011%
过去1年	1.9495%	0.0026%	1.9060%	0.0000%	0.0435%	0.0026%
自基金成立起至今	6.3177%	0.0027%	5.0366%	0.0000%	1.2811%	0.0027%

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:



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。本报告期内,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。

十五、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的基金管理费

基金管理人的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33%÷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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的托管费每日计算,按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提,计算方法为:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2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、休息日,支付日期顺延。

其他与基金运作有关的费用根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

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资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(二)与销售有关的费用

1、本基金不收取申购费、赎回费。

2、本基金依照相关法律法规和《基金合同》的规定收取基金销售与持有人服务费:

基金销售与持有人服务费按每日计算,按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法为:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金销售与持有人服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售与持有人服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售与持有人服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金销售机构,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。本项费用专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

3、基金的转换费

(1)前端转换费率表:

前端长信利息收益基金(519999)与前端收费长信金利趋势基金(519995)及前端收费长信银利精选基金(519997)相互转换费率:

转入方 转出方	长信利息收益基金(前端收费)	长信银利精选基金(前端收费)	长信金利趋势基金(前端收费)
长信利息收益基金(前端收费)	—	N<2年　1.50% 2年≤N<3年　1.20% 3年≤N　0.90%	N<2年　1.50% 2年≤N<3年　1.20% 3年≤N　0.90%
长信银利精选基金(前端收费)	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0	—	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0
长信金利趋势基金(前端收费)	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0	—

(2)后端转换费率表:

后端长信利息收益基金(519998)与后端收费长信金利趋势基金(519994)及后端收费长信银利精选基金(519996)相互转换费率:

转入方 转出方	长信利息收益基金(后端收费)	长信银利精选基金(后端收费)	长信金利趋势基金(后端收费)
长信利息收益基金(后端收费)	—	转换时不收取转换费,赎回时需按后端申购费率与赎回费一并收取后端申购费	转换时不收取转换费,赎回时需按后端申购费率与赎回费一并收取后端申购费
长信银利精选基金(后端收费)	N<1年　1.80% 1年≤N<2年　1.50% 2年≤N<3年　1.25% 3年≤N<5年　0.60% N≥5年　0	—	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0
长信金利趋势基金(后端收费)	N<1年　1.80% 1年≤N<2年　1.50% 2年≤N<3年　1.25% 3年≤N<5年　0.60% N≥5年　0	N<2年　0.50% 2年≤N<3年　0.25% 3年≤N　0	—

(1)N:持有年限

(2)长信银利精选基金(后端收费)和长信金利趋势基金(后端收费)转换时,转换入的基金份额赎回时需按后端申购费率与赎回费一并收取后端申购费。

由于中国农业银行渠道仅推行后端收费,因此中国农业银行仅实行后端转换模式。

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

十六、基金的收益与分配

(一)收益分配原则

1、基金收益分配采用红利再投资分红方式,投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益;

2、"每日分配、按月结转"。本基金从2007年4月1日起,收益分配由以前的"每日分配、每日结转"改为"每日分配、按月结转",即本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资者每日计算并分配当日收益,每月集中结转收益,使基金帐面份额净值始终保持1.00元。若投资者赎回基金份额时,该赎回份额对应的待支付收益将与赎回款项一起结算并支付,若收益为负值,则将从投资者赎回基金款中扣除。

3. 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起,不享有基金的分配权益。

4. 本基金收益每月集中支付一次,基金合同生效不满一个月不支付。每一基金份额享有同等分配权。

5、在符合法律法规的前提下,本基金根据每日收益情况将当日收益全部分配,即当日收益分配比例为100%。如当日收益为正,则相应增加基金份额;如当日收益为负,则不进行收益分配并相应减少基金份额,保持基金份额净值为1元;

6、投资者当日收益的精度为0.01元,收益分派计算结果如为正,实行小数点第三位后截除,剩余部分划归基金财产;收益分派计算结果如为负,实行小数点第三位非0即入,剩余部分划归基金财产;

7、在不影响投资者利益情况下,基金管理人可酌情调整基金收益分配方式,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

(二)收益分配方案

本基金收益根据本基金合同规定的分配原则进行分配,收益公告由基金管理人编制,经基金托管人复核,每开放日公告一次,披露公告截止日前一个开放日每万份基金净收益及7日年化收益率。若遇法定节假日,应于节假日结束后第二个自然日,披露节假日期间的每万份基金净收益和节假日最后一日的7日年化收益率,以及节假日后首个开放日的每万份基金净收益和7日年化收益率。基金管理人不另行公告基金收益分配方案。对上述事项,法律法规有新的规定时,基金管理人应按新的规定作出调整。

(三)收益公告

本基金每开放日公布前一开放日基金日收益以及基金7日年收益率。基金收益公告由基金管理人拟定,基金托管人核实后确定。本基金按日计算收益,基金管理人不另行公告基金收益分配方案。

公告日前一开放日每万份基金份额收益(基金日收益)=[当日基金净收益/当日基金发行在外的总份额]*10000

结果精度为0.0001,第五位采用截位的方式。

公告日最近7日收益折算的年资产收益率(%)(基金7日年化收益率)从2007年4月1日起改为 按月结转份额的7日年化收益率

$$=\left[\left(\sum_{i=1}^{7} Ri/7\right)\times 365/10000\right]\times 100\%;$$

其中,Ri为最近第i个自然日(包括计算当日)的每万份基金净收益,如不足7日,则采取上述公式类似计算。

十七、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(《长信利息收益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,基金管理人概况中,更新了基金管理人主要人员中,对本基金管理人经理层、投资决策委员会及基金经理的成员进行了更新;并对内部组织结构和员工情况进行了更新;

2.在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关业务经营情况的有关资料;

3.更新了"五、相关服务机构"中的"会计师事务所和经办注册会计师"的基本信息;

4.在"七、基金的投资"部分,更新了最近一期投资组合报告的内容;

5.在"九、基金的业绩"部分,更新了基金的投资业绩;

6.在"十二、基金的收益分配"部分,修改了本基金的收益分配结转周期;

7.在"二十二、其他应披露的事项"部分,更新了2006年10月1日至2007年2月30日本基金的相关公告事项,披露如下:

(1)2006年10月23日基金管理人公告了《长信利息收益基金收益分配的提示性公告(2006年第10号)》;

(2)2006年11月7日基金管理人公告了《长信利息收益基金招募说明书更新摘要(2006年第2号)》;

(3)2006年11月21日基金管理人公告了《长信利息收益基金收益分配的提示性公告(2006年第11号)》;

(4)2006年11月30日基金管理人公告了《长信基金管理有限责任公司关于蒋学杰先生担任公司副总经理的公告》;

(5)2006年12月21日基金管理人公告了《长信利息收益基金收益分配的提示性公告(2006年第12号)》;

(6)2006年12月26日基金管理人公告了《长信基金管理有限责任公司关于开通代销机构基金转换业务以及调整基金转换业务转换费率的公告》;

(7)2007年1月19日基金管理人公告了《长信利息收益基金2006年第四季度报告》;

(8)2007年1月20日基金管理人公告了《长信基金管理有限责任公司关于旗下基金更改直销网点首次申购最低限额的公告》;

(9)2007年1月22日基金管理人公告了《长信利息收益基金收益分配的提示性公告(2007年第1号)》。

长信基金管理有限责任公司
2007年5月14日

证券代码:600745 证券简称:S*ST 天华 编号:临 2007-024 号

湖北股份有限公司关于本公司股改进展的风险提示公告

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示:

●本公司在近一周内不能披露股改方案,请投资者注意投资风险。

●目前,本公司提出股改动议的非流通股股东持股数(已经)达到《上市公司股权分置改革管理办法》规定的三分之二的界限。

一、目前公司非流通股股东股改动议情况

目前,书面同意股改的非流通股股东有 7 家,其持股总数占非流通股股份总数比例为 66.7%,已经达到《上市公司股权分置改革管理办法》规定的三分之二的界限。

目前,本公司未能进行股改的原因是:沟通无法达成一致意见。

目前,尚未书面同意股改的非流通股股东有 12 家,其未明确同意股改的主要原因是:无法联系。

二、公司股改保荐机构情况

目前,本公司已经)与保荐机构西南证券签定股改保荐合同,保荐机构将协助制定本公司股改方案并出具保荐意见书。

三、保密及董事责任

本公司全体董事确认并已明确告知相关当事人,按照《上市公司股权分置改革管理办法》第七条等的规定履行保密义务。

本公司全体董事保证将按照《股票上市规则》第 7.3、7.4 条等的规定及时披露股改相关事项。

本公司全体董事确认已知《刑法》、《证券法》、《上市公司股权分置改革管理办法》等对未按规定披露信息、内幕交易等的罚则。

特此公告。

湖北天华股份有限公司
2007 年 5 月 14 日

股票名称:SST 天海 ST 天海 B　股票代码:600751 900938　编号:临 2007-019

天津市海运股份有限公司关于本公司股改进展的风险提示公告

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示:

本公司在在近一周内不能确定是否能披露股改方案,请投资者注意投资风险。

目前,本公司提出股改动议的非流通股股东持股数尚未达到《上市公司股权分置改革管理办法》规定的三分之二的界限。

一、目前公司非流通股股东股改动议情况

目前,书面同意股改的非流通股股东有 0 家,其持股总数占非流通股股份总数的比例为 0%,尚未达到《上市公司股权分置改革管理办法》规定的三分之二的界限。

目前,本公司未能进行股改的原因是:日前本公司接到通知,控股股东天海集团有限公司与海航集团有限公司对本公司的重组框架合作协议有效期延长两个月至 2007 年 5 月 27 日。鉴于以上事项可能引起的股权变更对本公司的重大影响,天海集团有限公司与海航集团有限公司协商,选择适当时机尽快启动股改工作。具体内容请投资者参阅本公司以前披露的公告。

目前,尚未书面同意股改的非流通股股东为全体非流通股股东,其未明确同意股改的主要原因同上。

二、公司股改保荐机构情况

目前,公司已经与保荐机构签定股改保荐合同,保荐机构将协助制定本公司股改方案并出具保荐意见书。

三、保密及董事责任

本公司全体董事确认并已明确告知相关当事人,按照《上市公司股权分置改革管理办法》第七条等的规定履行保密义务。

本公司全体董事保证将按照《股票上市规则》第 7.3、7.4 条等的规定及时披露股改相关事项。

本公司全体董事确认以知《刑法》、《证券法》、《上市公司股权分置改革管理办法》等对未按照规定披露信息、内幕交易等的罚则。

特此公告。

天津市海运股份有限公司
2007 年 5 月 14 日