长信中短债证券投资基金更新的招募说明书摘要

2011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：中国邮政储蓄银行有限责任公司

长信中短债证券投资基金（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许可【2010】481号文核准募集。本基金的基金合同于2010年6月28日正式生效。本基金为债券型契约开放式基金。

重要提示：

本基金于2010年4月19日经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】481号文核准募集。本基金的基金合同于2010年6月28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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（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，充分考虑投资者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者基金投资要承担相应风险，包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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，由于基金投资者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。

本基金为中短期债券基金，中短期债券基金不等于货币市场基金。投资者需注意金融市场利率波动会导致债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于债券，收益水平会受到利率变化的影响，利率波动可能导致本基金跌破面值，在利率波动时本基金的净值波动一般会高于货币市场基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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2011年6月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年3月31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	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	周宏
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、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
田丹	董事长	男	中共党员，硕士，EMBA。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，兼长江证券股份有限公司第六届监事会召集人。
胡运钊	董事	男	中共党员，在职研究生学历，高级经济师。曾任湖北省经委工业处副处长、处长，黄石市人民政府副市长，中共黄石市委常委、常务副市长，湖北省人民政府副秘书长，省政府副秘书长兼办公厅主任，办公厅党组副书记，长江证券有限责任公司党委书记。现任长江证券股份有限公司董事长、党委书记。
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，武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。
李国洪	董事	男	硕士研究生学历。曾担任长江证券股份有限公司投资银行部业务主管，法律事务部经理，债权债务中心总经理，资产保全事业部总经理，办公室总经理，副总裁。现任长江证券股份有限公司合规总监，长江期货有限公司监事会主席。
徐文彬	董事	男	中共党员，本科学历。曾任步兵273团政治处主任，步兵271团政委，上海松江区建委书记，松江区小昆山镇和洞泾镇党委书记，上海海欣集团股份有限公司监事会主席、副总裁、总裁。现任上海海欣集团股份有限公司董事长、党委书记。
陈谋亮	董事	男	中共党员，博士，高级经济师，高级商务谈判师。曾任湖北经济学院讲师；扬子石化化工厂、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；上海交大南洋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、总裁助理、战略投资管理部常务副总监、总监。现任上海海欣集团股份有限公司常务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
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科，正高职高级会计师。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长。现任武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长。
柳杨	监事	男	硕士研究生学历。曾担任长江证券股份有限公司财务总部经理、总经理助理、副总经理、总经理。现任长江证券股份有限公司财务负责人兼财务总部主管。
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。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部（筹）负责人。
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副总监。

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。
付勇	副总经理	男	金融学博士，北京大学金融学专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾任中国建设银行个人金融业务部主任科员、华龙证券投资银行北京总部副总经理、东北证券北京总部总经理助理、东方基金副总经理。2006年1月至2010年2月任东方基金公司东方精选混合型证券投资基金的基金经理，2008年6月至2010年2月任东方基金公司东方策略成长股票型证券投资基金的基金经理。2010年3月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，兼任长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理。
覃波	副总经理	男	硕士，上海国家会计学院EMBA毕业，具有基金从业资格。曾在长江证券公司从事资产管理和债券承销发行工作。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。现任长信基金管理有限责任公司副总经理。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
李小羽	基金经理	自本基金合同生效之日起	管理学硕士，华南理工大学管理工程研究生毕业，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任长城证券公司证券分析师，加拿大Investors Group Financial Services Co.，Ltd投资经理和投资顾问，2002年10月加入本公司（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。现任固定收益部总监、长信利丰债券型证券投资基金和本基金的基金经理。
张文刚	基金经理	自本基金合同生效之日起	高级工商管理硕士，上海财经大学EMBA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、长信利息收益货币基金基金经理职务，现任固定收益部副总监、本基金和长信利鑫分级债券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
蒋学杰	总经理
付 勇	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势股票型证券投资基金的基金经理
叶 琦	总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监
胡志宝	公司投资总监、投资决策委员会执行委员、长信银利精选开放式证券投资基金的基金经理、长信增利动态策略股票型证券投资基金的基金经理
钱 斌	研究发展部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李小羽	固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金的基金经理、长信中短债证券投资基金的基金经理
李洪书	交易管理部副总监
薛 天	国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金的基金经理

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		
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、产品开发部		
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处		
员工总数	101人（截至2011年6月28日）		
员工学历构成	学历 / 人数 / 占比		
	博士 / 3人 / 3%		
	硕士 / 52人 / 52%		
	本科 / 39人 / 38%		
	专科 / 5人 / 5%		
	其它 / 2人 / 2%		
	总计 / 101人 / 100%		

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：刘安东

成立时间：2007年03月06日

组织形式：有限责任公司

注册资本：肆佰壹拾亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484号

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：（010）68858126

2、主要人员情况

徐进，托管业务部总经理，13年金融从业经历，曾就职于中国邮政储蓄银行汇兑业务部、代理业务部，具有丰富的金融业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2011年6月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共5只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金(519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）。托管的特定客户资产管理计划共10只，其中5只已到期，包括南方－灵活配置之出口复苏1号资产管理计划、景顺长城基金－邮储银行－稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金－邮储银行－绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信－邮储银行－灵活配置1号客户资产管理计划、大成－邮储银行－灵活配置1号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛－邮储－灵活配置2号资产管理计划、南方灵活配置2号资产管理计划等。至今中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达273.28亿元。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销中心：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号时代金融中心九楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心九楼

法定代表人：田丹　联系人：孙赵辉

电话：021-61009916　传真：021-61009917

客户服务电话：400-700-5566　公司网站：www.cxfund.com.cn

2、场外代销机构

（1）中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座6层

法定代表人：刘安东 传真：010-68858117

客户服务电话：95580 网址：www.psbc.com

（2）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：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波 联系人：滕涛

电话：010-85108229 传真：010-85109219

客户服务电话：95599 网址：www.abchina.com

（3）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：姜建清

客户服务电话：95588 网址：www.icbc.com.cn

（4）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566 网址：www.boc.cn

（5）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：郭树清

客户服务电话：95533 联系人：张静

传真：010-66275654 网址：www.ccb.com

（6）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：胡怀邦 联系人：曹格

电话：021-58781234 传真：021-58408483

客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

（7）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：傅育宁 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

（8）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

（9）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

（10）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

电话：010-65557083 联系人：丰靖

客户服务电话：95558 公司网址：bank.ecitic.com

（11）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

法定代表人：吴建 联系人：郑鹏

电话：010-85238667 传真：010-85238419

客户服务电话：010-95577 公司网址：www.hxb.com.cn

（12）汉口银行股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区建设大道933号武汉商业银行大厦

办公地址：武汉市江汉区建设大道933号

法定代表人：陈新民 联系人：骆芸

电话：027-82656224 传真：027-82656236

客户服务电话：（027）96558，4006096558 公司网址：www.hkbchina.com

（13）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

（14）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华 联系人：匡婷

电话：0755-83516289 传真：0755-83516199

客户服务电话：400-6666-888 网址：www.cgws.com

（15）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：027-65799999 传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999 网址：www.95579.com

（16）大通证券股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市中山区人民路24号

办公地址：辽宁省大连市中山区延安路1号保嘉大厦15-16层

法定代表人：于宏民 联系人：谢立军

电话：0411-39673202 传真：0411-39673219

客户服务电话：4008-169-169 网址：www.datcn.com.cn

（17）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

（18）第一创业证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民 联系人：魏巍

电话：0755-25832852 传真：0755-82485081

客户服务电话：400-888-1888 网址：www.firstcapital.com.cn

（19）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：潘鑫军 联系人：吴宇

电话：021-63325888 传真：021-63326786

客户服务电话：95503 网址：www.dfzq.com.cn

（20）东莞证券有限责任公司

注册地址：莞城区可园南路1号金源中心30楼

办公地址：莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：张运勇 联系人：梁健伟、张巧玲

电话：0769-22100159 传真：0769-22119423

客户服务电话：0769-961130 网址：www.dgzq.com.cn

（21）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

办公地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人：吴永敏 联系人：方晓丹

电话：0512-65581136 传真：0512-65588021

客户服务电话：0512-33396288 网址：www.dwzq.com.cn

（22）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：徐浩明 联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999 传真：021-22169134

客户服务电话：4008888788、10108998 网址：www.ebscn.com

（23）广发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：0591-87841160 传真：0591-87841150

客户服务电话：0591-96326 网址：www.gfhfzq.com.cn

（24）广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人：王志伟 联系人：黄岚

电话：020-87555888 转各营业网点 传真：020-87557985

客户服务电话：95575 或致电各地营业部 网址：www.gf.com.cn

（25）国都证券有限责任公司

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楼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楼10层

法定代表人：常喆 联系人：黄静

电话：010-84183389 传真：010-84183311-3389

客户服务电话：400-818-8118 网址：www.guodu.com

（26）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：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云 联系人：金喆

电话：028-86690126 传真：028-86690126

客户服务电话：4006600109 网址：www.gjzq.com.cn

（27）国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街168号

办公地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼

法定代表人：雷建辉 联系人：徐欣

电话：0510-82831662 传真：0510-82830162

客户服务电话：4008885288 网址：www.glsc.com.cn

（28）国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）

办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）

法定代表人：曾小普 联系人：吴绍平

电话：0791-6281061 传真：0791-6281061

客户服务电话：4008-222-111 网址：www.gsstock.com

（29）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：上海市浦东新区银城中路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：021-38676666 传真：021-38670666

客户服务热线：4008888666 网址：www.gtja.com

（30）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：齐晓燕

电话：0755-82130833 传真：0755-82133952

客户服务电话：95536 网址：www.guosen.com

（31）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志 联系人：李蔡

电话：05551-2615542 传真：0551-2634906

客户服务电话：955784008-888-777 网址：www.gyzq.com.cn

（32）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 或 95553 网址：www.htsec.com

（33）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：冯戎 联系人：李巍

电话：010-88085858 传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562 网址：www.hysec.com

（34）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24-32层

法定代表人：李工 联系人：甘霖

电话：0551-5161666 传真：0551-5161600

客户服务电话：96518、400-80-96518 网址：www.hazq.com

（35）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 联系人：陈康菲

电话：021-50122222 传真：021-50122218

客户服务电话：400-820-9898 网址：www.cnhbstock.com

（36）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

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：李昕田

电话：0931-4890100 传真：0931-4890118

客户服务电话：0931-8730264 网址：www.hlzqgs.com

（37）华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马昭明 联系人：盛宗凌、庞晓芸

电话：0755-82492000 传真：0755-82492962

客户服务电话：95513 网址：www.lhzq.com

（38）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：樊昊

电话：0086-25-84457777 传真：0086-25-84579763

客户服务电话：95597 网址：www.htsc.com.cn

（39）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：张宇宏

电话：0451-82336863 传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288 网址：www.jhzq.com.cn

（40）中航证券有限公司

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号教育出版大厦904室

法定代表人：杜航 联系人：余雅娜

电话：0791-6768763 传真：0791-6770178

客户服务电话：400-8866-567 网址：www.avicsec.com

（41）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经十路20518号

法定代表人：李玮 联系人：吴阳

电话：0531-81283938 传真：0531-81283900

客户服务电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn

（42）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：郁忠民 联系人：张瑾

电话：021-53519888 传真：021-53519888

客户服务电话：4008918918、021-962518 网址：www.962518.com

（43）申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

（44）天风证券有限责任公司

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：翟璎

电话：027-87618882 传真：027-87618863

客服电话：028-86711410 网址：www.tfzq.com

（45）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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相 联系人：林爽

电话：010-66045608 传真：010-66045500

客户服务电话：010-66045678 网址：www.txsec.com

（46）天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼

法定代表人：裴东平 联系人：关键

电话：0755-33331188-8101 传真：0755-33329815

客户服务电话：400-65432-18 网址：www.tyzq.com.cn

（47）西藏同信证券有限责任公司

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：王伟光

电话：021-36533016 传真：021-36533017

客户服务电话：400-8811-177 网址：www.xzsec.com

（48）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：林生迎

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

（49）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

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：姜建平

电话：010-59355543 传真：010-66553791

客户服务电话：40088-95618 网址：www.e5618.com

（50）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：顾伟国 联系人：田薇

电话：010-66568888 传真：010-66568536

客户服务电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn

（51）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：010-85130588 传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108 网址：www.csc108.com

（52）中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼4、19、20层

法定代表人：刘军 联系人：俞会亮

电话：0571-85776115 传真：0571-85783771

客户服务电话：96598 网址：www.bigsun.com.cn

（53）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明 联系人：陈忠

电话：010-84683893 传真：010-84685560

客户服务电话：95558 网址：www.citics.com

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_szjit.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	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	010-59378839	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	朱立元	梁丽金、刘佳	黄小熠、王国蓉

四、基金的名称

长信中短债证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金把投资组合的久期控制在三年以内，在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上，力争实现超越比较基准的投资收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、央行票据、回购、可转债（不包括分离交易可转债）以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金对可转债的投资仅限于可转债的申购，且申购获得的可转债不得转换成股票。

本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的80%。本基金持有的剩余期限在397天以内的债券、现金和剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%。本基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为中短债基金，采用积极管理型的投资策略，将投资组合的久期控制在三年以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益率。

1、久期及凸性控制策略

债券市场的收益率曲线随时间变化而变化，本基金将根据收益率曲线的变化，和对利率走势变化的判断来进行久期选择及凸性管理，以最大限度地规避利率变动对投资组合的影响。

（1）久期选择

本基金为中短债基金，投资组合久期在三年以内，由于投资组合的久期为投资组合中单个债券久期的加权平均，因此本基金对组合久期的控制主要包括对单个债券投资品种久期的确定以及对投资组合内长久期的债券投资品种权重的控制。此外，为了保持本基金作为中短债基金的明显的风险收益特征，本基金将根据对国内外宏观经济形势、货币与财政政策以及债券市场资金供求状况等多方面因素的综合分析，判断中短期利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，动态调整组合久期。当预期收益率曲线下移时，可以适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，可以适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

（2）凸性管理

在价格－收益率出现大幅度变动时，它们的波动幅度呈非线性关系。用久期衡量债券的利率风险会有所偏离。凸性就是对这个偏离的修正。凸性越大，债券价格－收益率曲线弯曲程度也就越大，利率上行对债券价格造成的损失就越小，利率下行对债券价格带来的收益就越大；反之亦然。当预期收益率曲线变平时，可以构造哑铃型（Barbell）组合，通过侧重投资长期（剩余期限在7年及7年以下）和短期品种的债券来提高组合的凸性；当预期收益率曲线变陡时，可以构造子弹型（Bullet）组合，通过侧重投资中期品种的债券来降低组合的凸性。

2、优化配置策略

根据基金的投资目标和管理风格，分析符合投资标准的债券的各种量化指标，包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等，利用量化模型确定投资组合配置比例，实现既定条件下投资收益的最优化。

3、个券选择策略

本基金认为普通债券，包括国债、金融债、企业债和公司债的估值