

长信先优债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要 2018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:中国工商银行股份有限公司
长信先优债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2017年6月26日经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1021号文注册募集。
本基金合同于2017年8月1日正式生效。

重要提示
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注册,但中国证监会注册,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,投资者根据持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。
投资本基金可能遇到的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,利率风险,本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险,债券投资出现亏损的风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人,在基金管理人实施过程中产生的基金管理风险等。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
本基金的投范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。
投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目标、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本基金目标客户不包括特定的机构投资者,不属于定制基金。
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内容截止日为2018年8月1日,有关财务数据和净值截止日为2018年6月30日(财务数据未经审计)。
本基金托管人中国工商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

Table with 3 columns: 基金管理人概况, 股东信息, 股权结构. Includes details about Changxin Fund Management Co., Ltd. and its shareholders like Changjiang Securities and Shanghai Haifeng Investment Center.

(二)主要人员情况
1.基金管理人的董事会成员情况

Table listing board members including 成善株, 刘元瑞, 陈谋亮, 何宇城, 曹波, 吴耀祥, 谢红兵, 徐志刚 with their respective roles and backgrounds.

2、监事会成员

Table listing supervisory board members including 吴伟, 陈木元, 杨爱民, 李敏, 孙红辉, 魏晓东 with their roles and backgrounds.

3、经理层成员

Table listing management staff including 曹波, 周永刚, 邵彦明, 李小羽, 程春燕 with their roles and backgrounds.

注:1.上述人员之间均不存在近亲属关系;
2.本公司于2018年8月28日发布了《长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告》,聘任刘元瑞先生为本公司副总经理。

4、基金经理

Table listing fund managers including 曹波, 常松, 朱轶伦 with their roles and backgrounds.

注:1.上述人员之间均不存在近亲属关系;
2.自2018年8月31日起,宋海岩先生开始担任本基金的基金经理,常松先生不再担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

Table listing investment decision committee members including 曹波, 李小羽, 常松, 安岗, 杨帆, 高远, 易利红, 张文刚, 邓彪, 叶松, 左彦峰, 张岚岚, 姚奕帆, 秦娟, 李欣, 陈富平 with their roles and backgrounds.

注:1.上述人员之间均不存在近亲属关系;
2.自2018年8月9日起,左金保先生开始担任长信价值驱动混合型证券投资基金的基金经理;
3.自2018年8月16日起,叶松先生开始担任长信价值驱动混合型证券投资基金的基金经理;
4.本公司于2018年8月28日发布了《长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告》,聘任刘元瑞先生为本公司副总经理;
5.自2018年8月31日起,常松先生不再担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
6.自2018年8月31日起,高远先生开始担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
7.自2018年8月31日起,左金保先生开始担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
8.自2018年8月31日起,常松先生开始担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
9.自2018年8月31日起,杨帆女士开始担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
10.自2018年9月5日起,左金保先生不再担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理;
11.自2018年9月7日起,常松先生不再担任本公司投资决策委员会成员,聘任左金保先生为投资决策委员会成员;
12.自2018年9月7日起,姚奕帆先生不再担任本公司投资决策委员会成员,聘任左金保先生为投资决策委员会成员。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

(二)主要人员情况
截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

(四)基金托管人的内部控制制度
中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制放在首位,精心培育内控文化,完善风险内部控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明我行托管业务内控体系在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标
保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控完整化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构
中国工商银行资产托管部内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。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)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。
(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。
(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。
(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内部控制制度的检查、评价部门必须独立于内部控制制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施
(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,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,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务隔离和管理独立、网络独立。
(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管业务在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。
(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制意识。
(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动,处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。
(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。
(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。
(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练,为使演练更加接近实战,在实施演练过程中不断引入新技术标准,从最初的按照脚本时间演练发展到现在的“随机演练”,从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况
(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律法规,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。
(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体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,通过建立纵向双人制,横向各岗位之间的内部制衡机制,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重内部控制制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的观念和办法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一套系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。
(5)基金托管人对基金管理人运用基金进行监督的方法和程序
根据《基金法》、基金合同、托管协议及有关法律法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金业绩排名材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月内开始。
有关基金管理人违反基金合同、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人拒不执行通知的,违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。
三、相关服务机构
(一)基金份额销售机构

Table with 2 columns: 直销中心:长信基金管理有限责任公司, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

Table with 2 columns: 场外代销机构, 场外代销机构. Lists various distribution channels and contact information.

四、基金的名称
长信先优债券型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
通过积极主动的资产管理和严格的风险控制,在保持基金资产流动性的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供稳定增长的投资收益。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市、权证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、权证(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略
1、资产配置策略