

长信利保债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.1

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 长信利保债券 |
| 场内简称 | 长信利保 |
| 基金主代码 | 519947 |
| 交易代码 | 519947 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 11 月 16 日 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,599,250,706.07 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 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和有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资源配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 行业配置策略；</p> <p>(2) 个股投资策略。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持类证券等金融工具的投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+1.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|----------------------|----------------------|
| 名称 | | 长信基金管理有限责任公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-61009800 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cxfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼、北京西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -58,214,605.90 |
| 本期利润 | -55,341,546.86 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0258 |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.22% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0326 |
| 期末基金资产净值 | 1,562,170,055.98 |
| 期末基金份额净值 | 0.9768 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

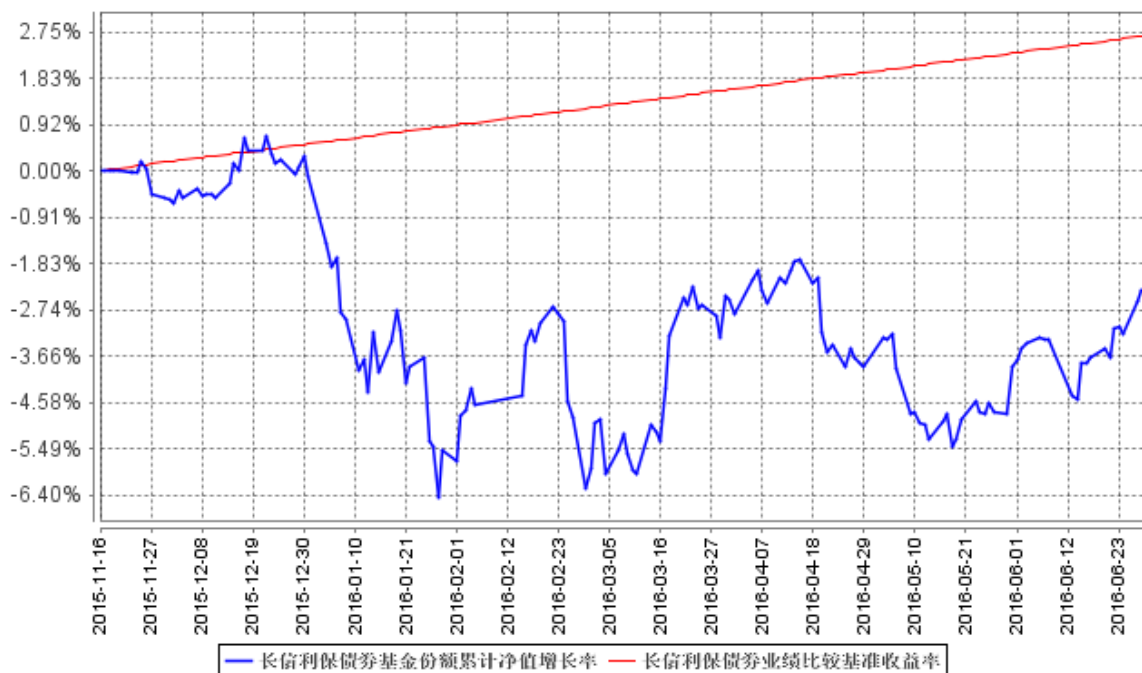
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.62% | 0.39% | 0.35% | 0.01% | 1.27% | 0.38% |
| 过去三个月 | 0.23% | 0.41% | 1.07% | 0.01% | -0.84% | 0.40% |
| 过去六个月 | -2.22% | 0.59% | 2.11% | 0.01% | -4.33% | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.32% | 0.53% | 2.65% | 0.01% | -4.97% | 0.52% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注： 1、本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 16 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2015 年 11 月 16 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2016年6月30日，本基金管理人共管理37只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫债券（LOF）、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券（LOF）、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合（LOF）、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券、长信中证能源互联网指数（LOF）、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券（QDII）、长信先锐债券、长信利发债券。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理） 期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|---------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李小羽 | 本基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利丰债券基金、长信利广混合基金、长信金葵纯债一年定开 | 2015年11月16日 | - | 18年 | 上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入长信基金管理有限责任公 |

| | | | | | |
|----|--|---------------------|---|-----|--|
| | 债券基金、长信利盈混合基金和长信利发债券基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员 | | | | 司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、固定收益部总监、总经理助理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员，本基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利丰债券基金、长信利广混合基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利盈混合基金和长信利发债券基金的基金经理。 |
| 刘波 | 本基金、长信利众债券基金（LOF）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理。 | 2015 年 11 月 16 日 | - | 9 年 | 经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011 年 2 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益货币基金的基金经理。现任本基金、长信利众债券基金（LOF）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理。 |

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年以来，全球经济继续维持弱复苏状态，美联储加息一次后受制于经济增长和通胀因素开始趋于谨慎，新兴市场货币和股市年初大幅下跌后逐渐企稳。6 月英国脱欧事件对全球金融市场冲击较大，全球风险偏好下降。2016 年上半年中国经济继续缓慢下行，一季度发放天量信贷后数据开始降温。大宗商品价格在一季度暴涨后开始回调，带动 CPI 小幅下行。

2016 年一季度利率债收益率缓慢上行，城投收益率持续走低，4 月份债券市场经历了一波较大的调整，主要是资金利率短期波动，经济数据短期显著走强以及信用风险集中爆发所致。5 月

份，利空得到缓解：经济数据再度走弱，权威人士称经济 L 型，信贷社融不及预期；并且信用违约没有新增超预期的主体。之后债券收益率小幅下降，但整体买盘不踊跃。6 月份在英国脱欧事件带动下，避险情绪上升，债券市场走出了一波较好的行情。

本基金上半年维持信用债配置，适度控制久期，精选个券，规避信用风险，加大了灵活操作的力度，以提高组合的安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9768 元，报告期基金份额净值增长率为-2.22%，成立以来的累计净值为 0.9768 元，本期业绩比较基准增长率为 2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面来看，今年较去年出现了一些变化，随着外围市场不稳定导致政策预期波动较大，经济数据和金融市场都波动较大。大宗商品也开始逐渐走出几年的漫漫熊市，CPI 低位震荡，PPI 负值收窄。中央经济工作会议提出五大任务中去产能居首，过剩产能有序出清将加速，行业内破产清算、兼并重组加剧，产能过剩行业再融资难度加大，外部支持力度减弱，信用风险上升，需谨防踩雷，规避过剩产能主体发行的债券。未来一段时间是过剩债券到期的高峰期，下一个信用债的雷在哪里非常难判断，但经济继续探底，违约率上升毋庸置疑。货币政策方面今年将降准预期较大，但迟迟未有兑现，货币进一步宽松对实体边际效用减弱，反而容易推升资产泡沫，因此央行也较为谨慎。仍然维持利率债市场震荡，低等级债券承压的判断。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、股票交易部总监、量化投资部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可

以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 52,693,465.80 | 298,085,807.46 |
| 结算备付金 | 1,396,116.47 | 1,196,153.31 |
| 存出保证金 | 489,278.30 | 34,715.11 |
| 交易性金融资产 | 1,516,653,162.51 | 1,673,048,724.78 |
| 其中：股票投资 | 299,759,390.51 | 289,195,815.78 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,216,893,772.00 | 1,383,852,909.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 249,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 2,511,891.77 | - |
| 应收利息 | 23,101,864.60 | 42,757,956.67 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 57,341,600.00 | 149,999,317.13 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,654,187,379.45 | 2,414,122,674.46 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 49,999,805.00 | 99,999,730.00 |
| 应付证券清算款 | 40,006,577.69 | 154,685,837.37 |
| 应付赎回款 | 29,151.68 | 1,506,045.21 |
| 应付管理人报酬 | 850,020.72 | 997,525.50 |
| 应付托管费 | 242,863.05 | 285,007.30 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 639,673.30 | 562,799.61 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 应交税费 | 65,560.00 | - |
| 应付利息 | 19,507.76 | 15,419.60 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 164,164.27 | 123,398.79 |
| 负债合计 | 92,017,323.47 | 258,175,763.38 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,599,250,706.07 | 2,158,068,382.30 |
| 未分配利润 | -37,080,650.09 | -2,121,471.22 |
| 所有者权益合计 | 1,562,170,055.98 | 2,155,946,911.08 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,654,187,379.45 | 2,414,122,674.46 |

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9768 元，基金份额总额

1,599,250,706.07 份。

2、本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 | |
|-----------------------|---------------------------------|--|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
| 一、收入 | -42,061,050.13 | |
| 1.利息收入 | 34,110,510.21 | |
| 其中：存款利息收入 | 721,963.32 | |
| 债券利息收入 | 33,214,483.75 | |
| 资产支持证券利息收入 | - | |
| 买入返售金融资产收入 | 174,063.14 | |
| 其他利息收入 | - | |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -80,137,116.89 | |
| 其中：股票投资收益 | -54,526,738.13 | |
| 基金投资收益 | - | |
| 债券投资收益 | -26,551,307.50 | |
| 资产支持证券投资收益 | - | |
| 贵金属投资收益 | - | |
| 衍生工具收益 | - | |
| 股利收益 | 940,928.74 | |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 2,873,059.04 | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | |

| | |
|----------------------------|-----------------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 1,092,497.51 |
| 减：二、费用 | 13,280,496.73 |
| 1. 管理人报酬 | 7,194,625.03 |
| 2. 托管费 | 2,055,607.16 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 2,576,299.33 |
| 5. 利息支出 | 1,270,576.84 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,270,576.84 |
| 6. 其他费用 | 183,388.37 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -55,341,546.86 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -55,341,546.86 |

注：本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,158,068,382.30 | -2,121,471.22 | 2,155,946,911.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -55,341,546.86 | -55,341,546.86 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -558,817,676.23 | 20,382,367.99 | -538,435,308.24 |
| 其中：1.基金申购款 | 955,928,976.91 | -37,701,705.72 | 918,227,271.19 |
| 2. 基金赎回款 | -1,514,746,653.14 | 58,084,073.71 | -1,456,662,579.43 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少） | - | - | - |

| | | | |
|---------------------|------------------|----------------|------------------|
| 以“-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 1,599,250,706.07 | -37,080,650.09 | 1,562,170,055.98 |

注：本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|------------|
| <u>覃波</u> | <u>覃波</u> | <u>孙红辉</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利保债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 9 月 29 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长信利保债券型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]221 号)准予注册，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利保债券型证券投资基金证券投资基金合同》发售，基金合同于 2015 年 11 月 16 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金为债券型基金，本基金采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各自市场上不同投资品种的具体分析，共同构成基金的投资策略结构。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金于 2015 年 10 月 22 日至 2015 年 11 月 11 日募集，募集资金总额人民币 305,021,095.31 元，利息转份额人民币 108,078.34 元，募集规模为 305,129,173.65 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1500956 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利保债券型证券投资基金基金合同》和《长信利保债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为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股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或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的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资

产的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准：三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况、2016年1月1日至2016年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-金融所转移金融资产的账面价值

-结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场

交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信利保债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率逐日计提。

根据《长信利保债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明。

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 本基金适用的主要税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

- (5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6.2 应交税费

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应交债券利息收入所得税 | 65,560.00元 |

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-----------------|--------------------|
| 长信基金管理有限责任公司 | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 长信-策略 4 号资产管理计划 | 基金管理人管理的特定客户资产管理计划 |
| 长信-策略 6 号资产管理计划 | 基金管理人管理的特定客户资产管理计划 |
| 长信-优享 1 号资产管理计划 | 基金管理人管理的特定客户资产管理计划 |
| 长信-优享 2 号资产管理计划 | 基金管理人管理的特定客户资产管理计划 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,194,625.03 |

| | |
|-----------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 363,265.77 |
|-----------------|------------|

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,055,607.16 |

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

| 关联方名称 | 本期末 2016年6月30日 | | 上年末 2015年12月31日 | |
|---------------|-------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| | 持有基金份额 | 持有的基金份额占基金总 份额的比例 | 持有基金份额 | 持有的基金份额占 基金总份额的比例 |
| 长信-策略4号资产管理计划 | 320,756,777.24 | 20.06% | 377,670,803.47 | 17.50% |
| 长信-策略6号资产管理计划 | 172,120,530.21 | 10.76% | 179,905,627.64 | 8.34% |
| 长信-优享1号资产管理计划 | 7,726,570.28 | 0.48% | 7,726,570.28 | 0.36% |
| 长信优享2号资产管理计划 | 41,652,608.56 | 2.60% | - | - |

注：本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 52,693,465.80 | 659,566.20 |

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2016年6月30日的相关余额为人民币1,396,116.47元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

期末未持有应认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 002373 | 千方科技 | 2016年5月12日 | 临时停牌 | 14.94 | 2016年8月16日 | 16.43 | 803,112 | 13,734,209.84 | 11,998,493.28 | - |
| 300166 | 东方国信 | 2016年6月8日 | 临时停牌 | 27.47 | - | - | 369,000 | 9,137,183.75 | 10,136,430.00 | - |
| 600576 | 万家文化 | 2016年4月11日 | 临时停牌 | 22.35 | - | - | 298,100 | 5,236,850.00 | 6,662,535.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|-------|-----------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 300246 | 宝莱特 | 2016年6月29日 | 临时停牌 | 30.31 | 2016年7月1日 | 32.20 | 158,986 | 4,955,623.39 | 4,818,865.66 | - |
| 300353 | 东土科技 | 2016年6月23日 | 临时停牌 | 22.09 | - | - | 66,899 | 1,173,233.22 | 1,477,798.91 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,999,805.00 元，是以如下债券作为质押：

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|-----------------|--------|---------|---------------|
| 150408 | 15 农发 08 | 2016 年 7 月 11 日 | 100.95 | 500,000 | 50,475,000.00 |
| 合计 | | | | 500,000 | 50,475,000.00 |

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 299,759,390.51 | 18.12 |
| | 其中：股票 | 299,759,390.51 | 18.12 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,216,893,772.00 | 73.56 |
| | 其中：债券 | 1,216,893,772.00 | 73.56 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 54,089,582.27 | 3.27 |
| 7 | 其他各项资产 | 83,444,634.67 | 5.04 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 8 | 合计 | 1,654,187,379.45 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 126,416,641.00 | 8.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 9,649,284.00 | 0.62 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 155,470,345.83 | 9.95 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,439,348.84 | 0.48 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 594,872.00 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 188,898.84 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 299,759,390.51 | 19.19 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600728 | 佳都科技 | 1,251,544 | 12,165,007.68 | 0.78 |
| 2 | 600745 | 中茵股份 | 447,324 | 12,006,176.16 | 0.77 |
| 3 | 002373 | 千方科技 | 803,112 | 11,998,493.28 | 0.77 |
| 4 | 002402 | 和而泰 | 423,697 | 11,461,003.85 | 0.73 |
| 5 | 002230 | 科大讯飞 | 325,781 | 10,701,905.85 | 0.69 |
| 6 | 300166 | 东方国信 | 369,000 | 10,136,430.00 | 0.65 |
| 7 | 002439 | 启明星辰 | 391,557 | 10,113,917.31 | 0.65 |
| 8 | 300020 | 银江股份 | 526,104 | 9,785,534.40 | 0.63 |
| 9 | 002405 | 四维图新 | 375,745 | 9,243,327.00 | 0.59 |
| 10 | 300359 | 全通教育 | 311,255 | 9,231,823.30 | 0.59 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 002625 | 龙生股份 | 36,804,932.78 | 1.71 |
| 2 | 000988 | 华工科技 | 36,224,379.09 | 1.68 |
| 3 | 000697 | 炼石有色 | 35,854,223.98 | 1.66 |
| 4 | 300024 | 机器人 | 33,485,826.06 | 1.55 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 21,978,469.32 | 1.02 |
| 6 | 002488 | 金固股份 | 21,601,480.82 | 1.00 |
| 7 | 600718 | 东软集团 | 20,798,802.05 | 0.96 |
| 8 | 600745 | 中茵股份 | 18,182,037.94 | 0.84 |
| 9 | 600728 | 佳都科技 | 17,506,252.71 | 0.81 |
| 10 | 000555 | 神州信息 | 17,303,075.43 | 0.80 |
| 11 | 002230 | 科大讯飞 | 17,206,793.58 | 0.80 |
| 12 | 002373 | 千方科技 | 15,686,404.48 | 0.73 |
| 13 | 002268 | 卫士通 | 15,288,469.99 | 0.71 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 002284 | 亚太股份 | 15,181,617.22 | 0.70 |
| 15 | 600588 | 用友网络 | 14,564,390.24 | 0.68 |
| 16 | 002308 | 威创股份 | 14,460,622.50 | 0.67 |
| 17 | 600895 | 张江高科 | 14,271,367.40 | 0.66 |
| 18 | 600172 | 黄河旋风 | 14,264,095.96 | 0.66 |
| 19 | 002030 | 达安基因 | 13,474,785.65 | 0.63 |
| 20 | 300168 | 万达信息 | 13,216,596.57 | 0.61 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 000988 | 华工科技 | 40,767,291.91 | 1.89 |
| 2 | 002625 | 龙生股份 | 39,813,612.29 | 1.85 |
| 3 | 000697 | 炼石有色 | 36,813,773.87 | 1.71 |
| 4 | 300024 | 机器人 | 35,943,646.92 | 1.67 |
| 5 | 600895 | 张江高科 | 23,190,868.00 | 1.08 |
| 6 | 600410 | 华胜天成 | 21,377,781.96 | 0.99 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 21,258,294.06 | 0.99 |
| 8 | 000848 | 承德露露 | 18,765,508.21 | 0.87 |
| 9 | 600718 | 东软集团 | 18,731,194.12 | 0.87 |
| 10 | 600588 | 用友网络 | 17,106,396.94 | 0.79 |
| 11 | 300146 | 汤臣倍健 | 16,454,968.15 | 0.76 |
| 12 | 002284 | 亚太股份 | 15,630,399.47 | 0.72 |
| 13 | 002268 | 卫士通 | 15,280,938.00 | 0.71 |
| 14 | 300246 | 宝莱特 | 14,971,173.07 | 0.69 |
| 15 | 002273 | 水晶光电 | 14,605,647.62 | 0.68 |
| 16 | 002008 | 大族激光 | 14,316,496.52 | 0.66 |
| 17 | 600172 | 黄河旋风 | 14,178,665.07 | 0.66 |
| 18 | 002488 | 金固股份 | 14,056,277.88 | 0.65 |
| 19 | 002568 | 百润股份 | 13,928,364.56 | 0.65 |
| 20 | 300222 | 科大智能 | 13,775,643.93 | 0.64 |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 925,714,805.39 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 864,943,495.78 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 64,953,272.00 | 4.16 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,146,369,000.00 | 73.38 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,146,369,000.00 | 73.38 |
| 4 | 企业债券 | 5,571,500.00 | 0.36 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,216,893,772.00 | 77.90 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 150406 | 15 农发 06 | 2,000,000 | 203,200,000.00 | 13.01 |
| 2 | 150401 | 15 农发 01 | 1,800,000 | 183,006,000.00 | 11.71 |
| 3 | 140322 | 14 进出 22 | 1,400,000 | 142,772,000.00 | 9.14 |
| 4 | 150417 | 15 农发 17 | 1,200,000 | 121,044,000.00 | 7.75 |
| 5 | 150201 | 15 国开 01 | 1,000,000 | 101,610,000.00 | 6.50 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 489,278.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,511,891.77 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 23,101,864.60 |
| 5 | 应收申购款 | 57,341,600.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 83,444,634.67 |

7.12.4 期末持有的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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1 | 002373 | 千方科技 | 11,998,493.28 | 0.77 | 临时停牌 |
| 2 | 300166 | 东方国信 | 10,136,430.00 | 0.65 | 临时停牌 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,053 | 1,518,756.61 | 1,437,277,726.70 | 89.87% | 161,972,979.37 | 10.13% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 994.94 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015年11月16日）基金份额总额 | 305,129,173.65 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,158,068,382.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 955,928,976.91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,514,746,653.14 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,599,250,706.07 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

10.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|----------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 方正证券 | 1 | 970,420,341.82 | 54.19% | 806,711.65 | 52.24% | - |
| 兴业证券 | 1 | 264,751,472.00 | 14.79% | 220,088.78 | 14.25% | - |
| 光大证券 | 1 | 252,825,794.00 | 14.12% | 235,456.31 | 15.25% | - |
| 东北证券 | 1 | 168,471,607.14 | 9.41% | 156,896.19 | 10.16% | - |
| 招商证券 | 1 | 134,189,086.21 | 7.49% | 124,970.50 | 8.09% | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融 有限证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|----------------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 142,256,833.79 | 68.65% | - | - | - | - |
| 东北证券 | 14,961,040.00 | 7.22% | 135,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 49,999,500.00 | 24.13% | - | - | - | - |
| 中国国际金融 有限证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增方正证券 1 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）

和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

长信基金管理有限责任公司
2016年8月26日