

长信海外收益一年定期开放债券型证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2017 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 7 |
| 2.5 信息披露方式..... | 7 |
| 2.6 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.9 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..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |

| | |
|--|-----------|
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 37 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 37 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 37 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细..... | 37 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 38 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 38 |
| 7.7 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..... | 38 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 38 |
| 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金融衍生品投资明细..... | 39 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... | 39 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 39 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 40 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 41 |
| §10 重大事件揭示..... | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 42 |
| 10.8 其他重大事件..... | 43 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |

| | |
|--|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 46 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| §12 备查文件目录..... | 47 |
| 12.1 备查文件目录..... | 47 |
| 12.2 存放地点..... | 47 |
| 12.3 查阅方式..... | 47 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 基金名称 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长信海外收益一年定开债券（QDII） |
| 场内简称 | 长信海外 |
| 基金主代码 | 519939 |
| 交易代码 | 519939 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年5月19日 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 97,549,001.82份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下追求本金长期安全的基础上，通过积极和深入的宏观经济、行业和公司基本面研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。 |
| 投资策略 | 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。本基金将通过对相关市场的宏观经济状况、市场利率走势、债券利差、证券市场走势、信用风险情况、以及各类资产的不同风险和回报的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。 |
| 业绩比较基准 | 同期人民币三年期银行定期存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 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。 |

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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 010-58560666 |

| | | | |
|--------|------|----------------------------|-----------------------|
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 95568 |
| 传真 | | 021-61009800 | 010-58560798 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | | 成善栋 | 洪崎 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|------|----|--------|--|
| 名称 | 英文 | - | JPMorgan Chase Bank, National Association |
| | 中文 | - | 摩根大通银行 |
| 注册地址 | | - | 1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A. |
| 办公地址 | | - | 270 Park Avenue, New York, New York 10017 |
| 邮政编码 | | - | - |

2.5 信息披露方式

| | |
|----------------------|---------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报 |
| 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 9 楼，北京市西城区复兴门内大街 2 号 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|-----------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区太平桥大街 17 号 |

§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(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 14,134,613.72 |
| 本期利润 | -118,973.50 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0006 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.05% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 1,984,422.45 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0203 |
| 期末基金资产净值 | 99,533,424.27 |
| 期末基金份额净值 | 1.0203 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.21% |

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

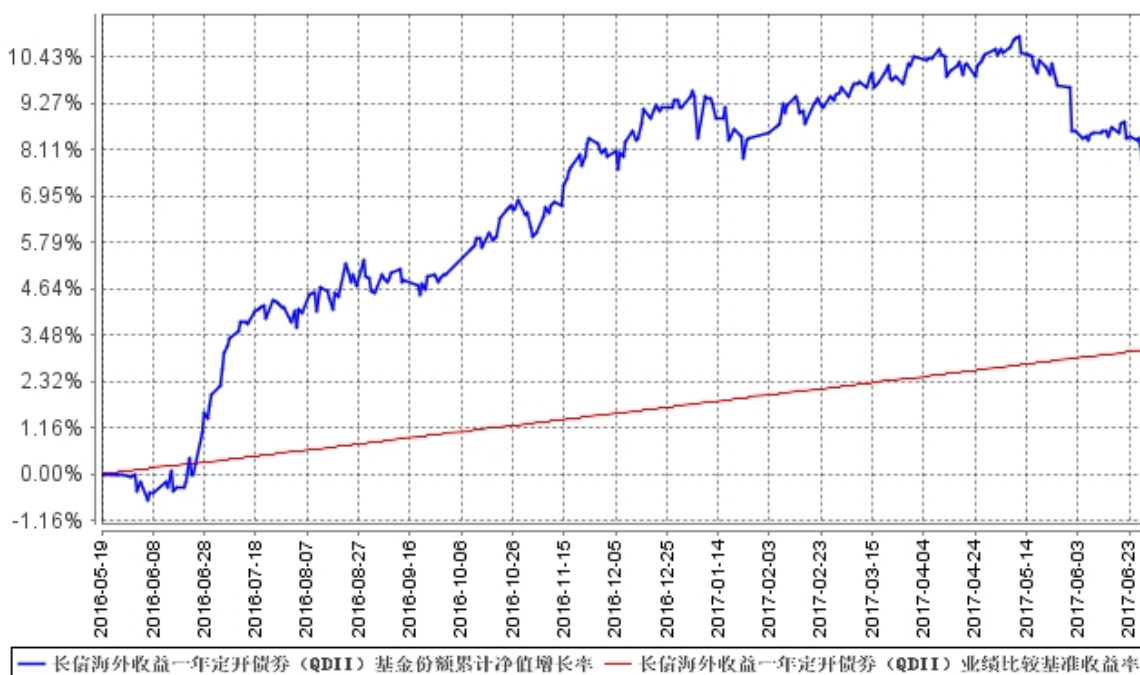
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -2.23% | 0.27% | 0.23% | 0.01% | -2.46% | 0.26% |
| 过去三个月 | -2.91% | 0.22% | 0.69% | 0.01% | -3.60% | 0.21% |
| 过去六个月 | -1.80% | 0.25% | 1.37% | 0.01% | -3.17% | 0.24% |
| 过去一年 | 5.40% | 0.25% | 2.79% | 0.01% | 2.61% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.21% | 0.26% | 3.12% | 0.01% | 4.09% | 0.25% |

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、图示日期为2016年5月19日至2017年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起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 1.65 亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为 4.54%。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配

置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）。

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 | | |
| 薛天 | 曾任本基金的基金经理 | 2016年5月19日 | 2017年6月28日 | 20年 | 曾任本基金的基金经理 |
| 杨帆 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理、国际业务部副总监 | 2017年4月20日 | - | 11年 | 工商管理学硕士，北京大学工商管理学硕士毕业，曾在莫尼塔投资发展有限公司担任研究员、敦和资产管理有限公司担任高级研究员，2017年3月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部副总监、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 傅瑶纯 | 长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理助理 | 2017年5月9日 | - | 2年 | 金融学硕士，毕业于英国华威大学，具有基金从业资格。曾任职于中国农业银行上海市分行、易唯思商务咨询有限公司，2016年4月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理助理。 |

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年度整个市场面临的主要风险事件来自于特朗普上任以后的政策实行是否会如期展开以及美联储是否会在上半年加息并对后市的展望。目前川普新医改案遇到较大障碍，令长

端国债利率始终保持 2%-2.3% 区间窄幅波动。上半年另外一个焦点则是美联储加息，如市场预期，美联储上半年总共加息两次，将联邦基金利率上调至 1.25%，目前市场预期美联储仍将于下半年再加息一次。同时，6 月份的议息会议上，美联储提出了未来的缩表计划，尽管该缩表计划在我们看来不利于长端国债价格的走势，但目前为止的市场表现非常温和。我们认为美国长端国债利率大概率已经触及了阶段性底部，未来收益率上行风险强于下行风险。

另一方面，受中国国内金融系统去杠杆和政治性事件冲击，中资美元债尤其是高收益债价格出现了回调，信用息差普遍扩张了 60-70 个基点左右。投资级别信用息差则由于避险因素保持低位并且进一步小幅收窄，目前投资级别信用息差处于历史极端低位。

上半年度基金净值出现了回撤，主要受整个上半年人民币升值、高收益债价格回调以及二季度基金打开期产生的置换成本造成。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0203 元，份额累计净值为 1.0739 元，本报告期内本基金净值增长率为-1.80%，期间人民币兑美元升值 2.40% 是拖累基金净值的首要因素，同时 5 月份基金打开期间出现大额赎回带来的置换成本也拖累了基金表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度我们将保持谨慎的操作策略，即保持短久期操作策略不变，并适当压缩高收益级别个券持仓，我们倾向于认为基准利率和信用息差下半年仍有进一步扩大空间，基金操作策略以防控风险为主。

4.7 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》，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，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门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该证券进行专项评估。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。

4.8 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，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：

权益登记日 2017 年 5 月 15 日，除息日 2017 年 5 月 12 日，每 10 份基金份额 0.536 元，现金形式发放 9,642,018.42 元，再投资形式发放 3,450,995.95 元，利润分配合计 13,093,014.37 元。

基金收益分配原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金在每个封闭期内收益至少分配 1 次，每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 100%；

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。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人与基金托管人协商一致后可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介和基金管理人网站公告。

4.9 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金进行了一次利润分配，利润分配合计 13,093,014.37 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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：长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.6.1 | 14,064,352.09 | 29,034,612.96 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 66,851,230.88 | 234,729,853.05 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 66,851,230.88 | 234,729,853.05 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.6.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.6.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 17,376,053.71 | - |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 1,484,475.89 | 3,342,518.70 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | - | - |
| 资产总计 | | 99,776,112.57 | 267,106,984.71 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.6.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 82,807.47 | 224,802.72 |
| 应付托管费 | | 20,701.88 | 56,200.69 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 139,178.95 | 150,000.00 |
| 负债合计 | | 242,688.30 | 431,003.41 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 97,549,001.82 | 244,272,655.91 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | 1,984,422.45 | 22,403,325.39 |
| 所有者权益合计 | | 99,533,424.27 | 266,675,981.30 |
| 负债和所有者权益总计 | | 99,776,112.57 | 267,106,984.71 |

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0203 元，基金份额总额 97,549,001.82 份；

2、本基金基金合同于 2016 年 5 月 19 日正式生效，上年度可比期间为 2016 年 5 月 19 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 5 月 19 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 1,425,655.38 | 5,080,521.08 |
| 1.利息收入 | | 6,943,813.30 | 708,009.35 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 28,449.11 | 78,084.44 |
| 债券利息收入 | | 6,915,364.19 | 629,924.91 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 9,650,317.43 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.6.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.6.14 | 9,650,317.43 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.6.14.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.6.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.6.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.6.17 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|-----------|----------------|--------------|
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.6.18 | -14,253,587.22 | 4,372,511.73 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -935,184.70 | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.6.19 | 20,296.57 | - |
| 减：二、费用 | | 1,544,628.88 | 351,379.21 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 1,150,631.96 | 280,143.38 |
| 2. 托管费 | 6.4.9.2.2 | 287,657.97 | 70,035.83 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.6.20 | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.6.21 | 106,338.95 | 1,200.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -118,973.50 | 4,729,141.87 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -118,973.50 | 4,729,141.87 |

注：本基金基金合同于2016年5月19日正式生效，上年度可比期间为2016年5月19日至2016年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017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） | 244,272,655.91 | 22,403,325.39 | 266,675,981.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | -118,973.50 | -118,973.50 |
| 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） | -146,723,654.09 | -7,206,915.07 | -153,930,569.16 |

| | | | |
|--|---|----------------|-----------------|
| 其中：1.基金申购款 | 8,031,810.68 | 404,426.89 | 8,436,237.57 |
| 2.基金赎回款 | -154,755,464.77 | -7,611,341.96 | -162,366,806.73 |
| 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） | - | -13,093,014.37 | -13,093,014.37 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 97,549,001.82 | 1,984,422.45 | 99,533,424.27 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年5月19日(基金合同生效日)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） | 244,272,655.91 | - | 244,272,655.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 4,729,141.87 | 4,729,141.87 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 244,272,655.91 | 4,729,141.87 | 249,001,797.78 |

注：本基金基金合同于2016年5月19日正式生效，上年度可比期间为2016年5月19日至2016年6月30日。

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：

成善栋

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2016]458号文)批准,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》等相关法规和《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年5月19日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为244,272,655.91份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”),境外资产托管人为摩根大通银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金主要投资于境外证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括债券、固定收益类基金、优先股、货币市场工具、结构性投资产品、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人与基金托管人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期前两个月、开放期及开放期结束后两个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,在非开放期,本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为:同期人民币三年期银行定期存款利率(税后)。

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颁布的《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 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.5 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[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[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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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：

(a) 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。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(c) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(d) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）

运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 14,064,352.09 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 14,064,352.09 |

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 66,124,439.75 | 66,851,230.88 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 66,124,439.75 | 66,851,230.88 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 66,124,439.75 | 66,851,230.88 | 726,791.13 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 491.20 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 1,483,984.69 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,484,475.89 |

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 审计费 | 74,712.18 |
| 信息披露费_中证报 | 24,795.19 |
| 信息披露费_上证报 | 39,671.58 |
| 合计 | 139,178.95 |

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|----|----------------------------|------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| | | |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 244,272,655.91 | 244,272,655.91 |
| 本期申购 | 8,031,810.68 | 8,031,810.68 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -154,755,464.77 | -154,755,464.77 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 97,549,001.82 | 97,549,001.82 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 7,422,947.04 | 14,980,378.35 | 22,403,325.39 |
| 本期利润 | 14,134,613.72 | -14,253,587.22 | -118,973.50 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,762,274.38 | -5,444,640.69 | -7,206,915.07 |
| 其中：基金申购款 | 81,344.36 | 323,082.53 | 404,426.89 |
| 基金赎回款 | -1,843,618.74 | -5,767,723.22 | -7,611,341.96 |
| 本期已分配利润 | -13,093,014.37 | - | -13,093,014.37 |
| 本期末 | 6,702,272.01 | -4,717,849.56 | 1,984,422.45 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 28,448.39 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 0.72 |
| 合计 | 28,449.11 |

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.6.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.6.14 债券投资收益**6.4.6.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 9,650,317.43 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 9,650,317.43 |

6.4.6.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 216,609,210.88 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 202,503,892.70 |
| 减：应收利息总额 | 4,455,000.75 |
| 买卖债券差价收入 | 9,650,317.43 |

6.4.6.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.15 贵金属投资收益**6.4.6.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.16 衍生工具收益**6.4.6.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利投资收益。

6.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -14,253,587.22 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -14,253,587.22 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -14,253,587.22 |

6.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 20,296.57 |
| 其他收入 | - |
| 合计 | 20,296.57 |

注：本基金赎回费的25%归入基金资产。

6.4.6.20 交易费用

注：本基金本报告期无交易费用。

6.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 34,712.18 |
| 信息披露费 | 64,466.77 |

| | |
|-------|------------|
| 银行汇划费 | 7,160.00 |
| 合计 | 106,338.95 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心（有限合伙）和上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于2017年2月8日就上述股东变更事项进行公告。

6.4.8.2 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 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 摩根大通银行 | 基金境外托管人 |

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.9.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6 月30日 | 上年度可比期间 2016年5月19日(基金合同生效 日)至2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,150,631.96 | 280,143.38 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 351,072.19 | 94,021.45 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$\text{每日应计提的基金管理费} = \text{前一日的基金资产净值} \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6 月30日 | 上年度可比期间 2016年5月19日(基金合同生效 日)至2016年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 287,657.97 | 70,035.83 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$\text{每日应计提的基金托管费} = \text{前一日的基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年5月19日(基金合同生效日)至2016年6月30日 |
| 基金合同生效日（2016年5月19日）持有的基金份额 | - | 30,001,700.00 |
| 期初持有的基金份额 | 30,001,700.00 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 30,001,700.00 | 30,001,700.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 30.76% | 12.28% |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.9.4.2 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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------------|----------------------|-----------|--------------------------------|-----------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 2016年5月19日(基金合同生效日)至2016年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 2,456,640.70 | 28,448.39 | 2,401,563.36 | 78,084.44 |
| 摩根大通银行 | 11,607,711.39 | - | 31,744,767.11 | - |

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|--------------|--------------|---------------|----|
| 1 | 2017年5月15日 | 2017年5月12日 | 0.536 | 9,642,018.42 | 3,450,995.95 | 13,093,014.37 | |
| 合计 | - | - | 0.536 | 9,642,018.42 | 3,450,995.95 | 13,093,014.37 | |

6.4.11 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以

实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国民生银行股份有限公司以及境外次托管行摩根大通银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级债券。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| BBB- | 0.00 | 20,581,454.67 |
| BB+ | 7,025,797.98 | 0.00 |
| BB | 23,707,024.93 | 104,303,570.06 |
| BB- | 15,277,643.81 | 50,433,863.00 |
| B | 7,231,536.51 | 45,343,145.54 |

| | | |
|-----|---------------|----------------|
| 未评级 | 13,609,227.65 | 14,067,819.78 |
| 合计 | 66,851,230.88 | 234,729,853.05 |

注：上述评级采用标准普尔信用评级。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的量化投资部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年6月30日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|--------------|--------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 2,456,640.70 | - | - | - | 11,607,711.39 | 14,064,352.09 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 1,484,475.89 | 1,484,475.89 |
| 交易性金融资产 | - | - | 57,460,206.75 | 9,391,024.13 | - | 66,851,230.88 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 17,376,053.71 | 17,376,053.71 |
| 资产总计 | 2,456,640.70 | - | 57,460,206.75 | 9,391,024.13 | 30,468,240.99 | 99,776,112.57 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 82,807.47 | 82,807.47 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 20,701.88 | 20,701.88 |
| 预提费用 | - | - | - | - | 139,178.95 | 139,178.95 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 242,688.30 | 242,688.30 |
| 利率敏感度缺口 | 2,456,640.70 | - | 57,460,206.75 | 9,391,024.13 | 30,225,552.69 | 99,533,424.27 |
| 上年度末 2016年12月31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 715,030.45 | - | - | - | 28,319,582.51 | 29,034,612.96 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 3,342,518.70 | 3,342,518.70 |
| 交易性金融资产 | - | - | 178,555,307.05 | 56,174,546.00 | - | 234,729,853.05 |
| 资产总计 | 715,030.45 | - | 178,555,307.05 | 56,174,546.00 | 31,662,101.21 | 267,106,984.71 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 224,802.72 | 224,802.72 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 56,200.69 | 56,200.69 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 150,000.00 | 150,000.00 |
| 负债总计 | - | - | 0.00 | 0.00 | 431,003.41 | 431,003.41 |
| 利率敏感度缺口 | 715,030.45 | - | 178,555,307.05 | 56,174,546.00 | 31,231,097.80 | 266,675,981.30 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | |
|-----------------|--------------------|--|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
| | | <table border="1"> <tr> <td>本期末（2017年6月30日）</td> <td>上年度末（2016年12月31日）</td> </tr> </table> |
| 本期末（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） | |

| | | | |
|--|---------------|-------------|---------------|
| | 市场利率下降 27 个基点 | 434,059.71 | 1,300,654.50 |
| | 市场利率上升 27 个基点 | -434,059.71 | -1,300,654.50 |

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | | | |
|---------------|---------------------|-------------|---------------|----------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 11,608,056.68 | - | - | 11,608,056.68 |
| 交易性金融资产 | 66,851,230.88 | - | - | 66,851,230.88 |
| 应收利息 | 1,483,984.69 | - | - | 1,483,984.69 |
| 应收证券清算款 | 17,376,053.71 | - | - | 17,376,053.71 |
| 资产合计 | 97,319,325.96 | - | - | 97,319,325.96 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 97,319,325.96 | - | - | 97,319,325.96 |
| 项目 | 上年度末 2016年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 28,319,936.02 | - | - | 28,319,936.02 |
| 交易性金融资产 | 234,729,853.05 | - | - | 234,729,853.05 |
| 应收利息 | 3,342,361.40 | - | - | 3,342,361.40 |
| 资产合计 | 266,392,150.47 | - | - | 266,392,150.47 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 266,392,150.47 | - | - | 266,392,150.47 |

6.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | |
|-----------------|-------------------|--|
| 假设 | 除美元以外的其他市场变量保持不变 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
| | | <table border="1"> <tr> <td>本期末（2017年6月30日）</td> <td>上年度末（2016年12月31日）</td> </tr> </table> |
| 本期末（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） | |

| | | |
|----------------|---------------|----------------|
| 美元对人民币升值 5% | 4,865,966.30 | 13,319,607.52 |
| 美元对人民币贬值 5% | -4,865,966.30 | -13,319,607.52 |

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | | 上年度末 2016年12月31日 | |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 66,851,230.88 | 67.16 | 234,729,853.05 | 88.02 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 66,851,230.88 | 67.16 | 234,729,853.05 | 88.02 |

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资债券等固定收益品种，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 | | | |
|--------|------------|---------------|------|---------------|
| | 2017年6月30日 | | | |
| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 合计 |
| 股票投资 | - | - | - | - |
| 债券投资 | - | 66,851,230.88 | - | 66,851,230.88 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 合计 | - | 66,851,230.88 | - | 66,851,230.88 |

2017年上半年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2017年上半年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§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 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 66,851,230.88 | 67.00 |
| | 其中：债券 | 66,851,230.88 | 67.00 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,064,352.09 | 14.10 |
| 8 | 其他各项资产 | 18,860,529.60 | 18.90 |
| 9 | 合计 | 99,776,112.57 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未进行权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末进行权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末进行权益投资。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期末进行权益投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|------------|---------------|--------------|
| A+至 A- | - | - |
| BBB+至 BBB- | - | - |
| BB+至 BB- | 46,010,466.72 | 46.23 |
| B+至 B- | 14,164,931.68 | 14.23 |
| CCC+至 CCC | - | - |
| 未评级 | 6,675,832.48 | 6.71 |

注：本债券投资组合主要采用标准普尔提供的债券信用评级信息。

7.7 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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------|---------------------------|--------|--------------|--------------|
| 1 | XS1122780106 | BANK OF CHINA | 80,000 | 9,391,024.13 | 9.44 |
| 2 | XS1106299586 | OCEANWIDE REAL ESTATE IN | 10,000 | 7,231,536.51 | 7.27 |
| 3 | XS1415758991 | 361 DEGREES INTERNATIONAL | 10,000 | 7,187,773.89 | 7.22 |
| 4 | XS1164776020 | COUNTRY GARDEN HLDG CO | 10,000 | 7,128,226.91 | 7.16 |
| 5 | XS1266590089 | CARINC | 10,000 | 7,025,797.98 | 7.06 |

注：债券代码为 ISIN 码。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未投资基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.11.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,376,053.71 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,484,475.89 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,860,529.60 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未投资股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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 |
| 380 | 256,707.90 | 71,530,034.94 | 73.33% | 26,018,966.88 | 26.67% |

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 | 0.00 | 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(2016年5月19日)基金份额总额 | 244,272,655.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 244,272,655.91 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,031,810.68 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 154,755,464.77 |
| 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 | 97,549,001.82 |

注：本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。

本基金第一个开放期为2017年5月19日至2017年5月25日。

§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

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期本基金未改聘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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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 | |
| ZHONGTAI | - | - | - | - | - | - |
| Citibank N.A. | - | - | - | - | - | - |
| UBS | - | - | - | - | - | - |

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 | | 基金交易 | |
|----------------|----------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| ZHONGTAI | 59,972,814.22 | 24.56% | - | - | - | - | - | - |
| Citibank N. A. | 54,592,407.13 | 22.36% | - | - | - | - | - | - |
| UBS | 129,636,389.50 | 53.09% | - | - | - | - | - | - |

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

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。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-------------------|------------|
| 1 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年1月12日 |

| | | | |
|----|--|-------------------|------------|
| 2 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年1月13日 |
| 3 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年1月14日 |
| 4 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年1月17日 |
| 5 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年1月17日 |
| 6 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金2016年第4季度报告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017年1月21日 |
| 7 | 长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年2月8日 |
| 8 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年2月23日 |
| 9 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年3月10日 |
| 10 | 长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年3月22日 |
| 11 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年3月22日 |
| 12 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告及摘要（仅摘要见报） | 上证报、中证报、公司网站 | 2017年3月27日 |
| 13 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年3月30日 |
| 14 | 长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通过直销中心认购、申购旗下部分基金费率优惠的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年3月30日 |
| 15 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017年4月1日 |
| 16 | 长信基金管理有限责任公司关于增聘长 | 上证报、中证报、公 | 2017年4月20日 |

| | | | |
|----|--|-------------------|-----------------|
| | 信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理的公告 | 司网站 | |
| 17 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 4 月 22 日 |
| 18 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017 年 4 月 22 日 |
| 19 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 5 月 4 日 |
| 20 | 长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金的分红预告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 5 月 8 日 |
| 21 | 长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年第一次分红公告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 5 月 10 日 |
| 22 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017 年 5 月 12 日 |
| 23 | 长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 5 月 17 日 |
| 24 | 长信基金管理有限责任公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 5 月 23 日 |
| 25 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017 年 5 月 24 日 |
| 26 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中泰证券股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017 年 5 月 26 日 |
| 27 | 长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告 | 上证报、中证报、公司网站 | 2017 年 6 月 28 日 |
| 28 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 上证报、中证报、证券时报、公司网站 | 2017 年 6 月 30 日 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|--------------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017年5月22日至2017年6月30日 | 30,000,350.00 | 1,528,534.94 | 0.00 | 31,528,884.94 | 32.32% |
| | 2 | 2017年5月23日至2017年6月30日 | 30,001,700.00 | 0.00 | 0.00 | 30,001,700.00 | 30.76% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2017年8月24日