

# 长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

2019 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信上证港股通指数型发起式
基金主代码	519931
交易代码	519931
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 15 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,345,433.51 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在上证港股通指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×上证港股通指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	国泰君安证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	周永刚	王健
	联系电话	021-61009999	021-38676252
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4007005566	021-38917599-5
传真		021-61009800	021-38677819

## 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 9 楼、上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	442,626.63
本期利润	2,322,925.81
加权平均基金份额本期利润	0.1206
本期基金份额净值增长率	10.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0243
期末基金资产净值	21,562,707.70
期末基金份额净值	1.175

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。

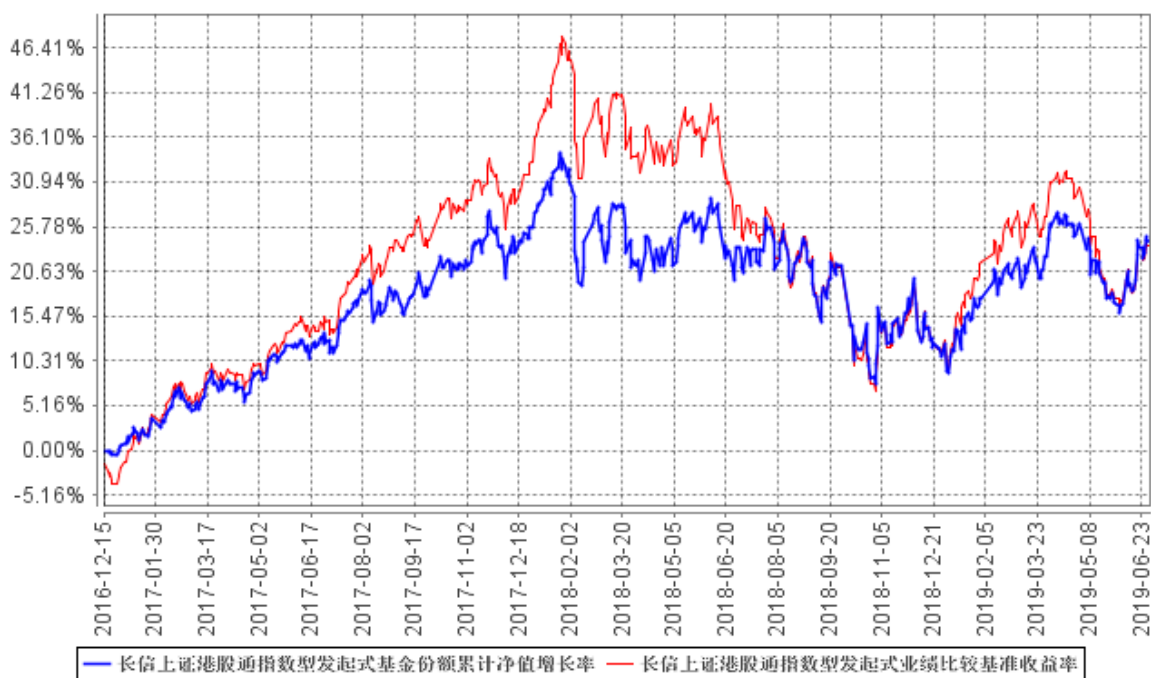
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	6.24%	1.04%	5.19%	1.01%	1.05%	0.03%
过去三个月	1.47%	0.94%	-2.66%	0.94%	4.13%	0.00%
过去六个月	10.51%	0.98%	9.52%	0.97%	0.99%	0.01%
过去一年	0.57%	1.15%	-3.71%	1.16%	4.28%	-0.01%
自基金合同生效起至今	24.11%	0.99%	23.52%	1.01%	0.59%	-0.02%

### 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 12 月 15 日至 2019 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。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%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 65 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、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型

发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金。

#### 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		
杨帆	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、国际业务部总监、投资决策委员会执行委员	2017 年 4 月 20 日	-	13 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，曾任长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，现任国际业务部总监和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、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型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	2017 年 5 月 9 日	-	4 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



	增强型证券投资基金、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			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 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

2019 上半年,恒生指数与上证港股通指数分别以 28542.62 点和 3469.41 点收盘,上涨 10.43% 和 10%。从全球来看,上半年新兴经济体的股票市场普遍走出了一轮反弹走势。港股除了 5 月出现下跌以外,其余月份均出现上涨行情。5 月的下跌行情主要受到贸易战等地缘政治因素影响。6 月初随着美股的反弹得到一定程度的修复,但程度远远不及美股,市场观望情绪浓重。随着 G20 谈判的缓和,港股估值得到进一步修复。预计两国将继续进行讨论协商,而对于贸易谈判的相关进展或将成为股市短期的催化剂。总体而言,上半年的波动率较 2018 年有所降低,基本维持在 20% 以下。从各行业的表现来看,上半年除了恒生能源行业下跌了 -0.72% 以外,其他行业均出现上涨行情。

从香港整体经济环境来看,自 2018 年 3 月以后,香港实际 GDP 季度同比增长率开始出现较为明显的下滑。香港实际 GDP 季度同比增长率从 2018 年 3 月的 4.6% 下跌至 2019 年 3 月的 0.6%, 达到近十年来的最低值。从经济增速来看,香港目前的经济处于触底阶段。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.175, 份额累计净值 1.239, 报告期内净值增长率 10.51%, 同期业绩比较基准为 9.52%, 同期人民币兑港币贬值 0.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,贸易战的不确定性仍是市场隐患之一,尽管目前市场投资者情绪有所恢复,风险偏好上升,但最新的中国经济数据仍然偏弱,受到一些行业消息或政策出台刺激而出现的上涨行情或难以维持,投资者需警惕突如其来的黑天鹅风险;另一方面,港股与美股仍存在一定的联动性,现阶段美国经济的持续上行存在一定压力,但短期仍存在较强韧性,而若下半年美联储实施降息,一定程度上或成为暂时延缓美国经济衰退的重要方式,短期内或提振美股的走势,从而有利于短期内港股的上涨。

本基金跟踪上证港股通指数,主要涵盖恒生指数大中型股票,剔除汇率因素,本基金与指数的误差控制在合理范围之内。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人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，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 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，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：

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	2019 年 2 月 21 日	2019 年 2 月 21 日	0.640	1,087,962.12	168,689.87	1,256,651.99	
合计	-	-	0.640	1,087,962.12	168,689.87	1,256,651.99	

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，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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信上证港股通指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	1,278,067.75	1,390,276.05
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	20,334,877.96	21,518,482.32
其中：股票投资	20,334,877.96	20,487,967.32
基金投资	-	-
债券投资	-	1,030,515.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	679.79	60,510.84
应收股利	109,698.20	-
应收申购款	5,986.96	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,729,310.66	22,969,269.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	-	-
应付证券清算款	4.47	4.43
应付赎回款	59,041.67	-
应付管理人报酬	13,878.34	15,505.10
应付托管费	3,469.61	3,876.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	357.30	218.42
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	89,851.57	210,000.00
负债合计	166,602.96	229,604.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	18,345,433.51	20,246,716.04
未分配利润	3,217,274.19	2,492,948.96
所有者权益合计	21,562,707.70	22,739,665.00
负债和所有者权益总计	21,729,310.66	22,969,269.21

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.175 元，基金份额总额 18,345,433.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	2,585,524.99	-153,600.56
1.利息收入	13,823.53	31,365.07
其中：存款利息收入	13,493.93	9,014.02
债券利息收入	329.60	22,054.55
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	296.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	683,797.31	751,289.62
其中：股票投资收益	400,476.32	480,051.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-19,589.47	414.37
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	302,910.46	270,823.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,880,299.18	-949,242.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7,604.97	12,987.44
<b>减：二、费用</b>	262,599.18	330,032.76

1. 管理人报酬	88,276.86	93,376.61
2. 托管费	22,069.20	23,344.16
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,581.54	14,131.23
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	139,671.58	199,180.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,322,925.81</b>	<b>-483,633.32</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,322,925.81</b>	<b>-483,633.32</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	20,246,716.04	2,492,948.96	22,739,665.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,322,925.81	2,322,925.81
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）	-1,901,282.53	-341,948.59	-2,243,231.12
其中：1.基金申购款	2,842,211.92	430,634.34	3,272,846.26
2.基金赎回款	-4,743,494.45	-772,582.93	-5,516,077.38
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）	-	-1,256,651.99	-1,256,651.99
五、期末所有者权益（基金净值）	18,345,433.51	3,217,274.19	21,562,707.70
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	17,934,317.89	4,594,890.83	22,529,208.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-483,633.32	-483,633.32
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）	795,286.85	267,647.98	1,062,934.83
其中：1.基金申购款	8,463,072.63	2,280,815.32	10,743,887.95
2.基金赎回款	-7,667,785.78	-2,013,167.34	-9,680,953.12
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）	18,729,604.74	4,378,905.49	23,108,510.23

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>成善栋</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

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《长信上证港股通指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]2801号文及机构部函[2016]1461号文批准公开募集。本基金为契约型开放式,发起式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为17,101,684.96份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振字第1600908号的验资报告。基金合同于2016年12月15日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信上证港

股通指数型发起式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金融工具，以上证港股通指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于银行存款、债券、债券回购、权证、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于上证港股通指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 90%。本基金投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{上证港股通指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$ 。本基金的标的指数为：上证港股通指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2008]1 号《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》、2008

年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国泰君安证券股份 有限公司	-	-	867,974.76	10.14%

#### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的 比例
国泰君安证券股份 有限公司	-	-	2,746,233.10	100.00%

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
国泰君安证券股份 有限公司	-	-	500,000.00	100.00%

#### 6.4.7.1.4 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。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证 券股份有限 公司	347.19	10.14%	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安证券获得证券研究综合服务。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	88,276.86
其中：支付销售机构的客	18,227.60	17,882.07

户维护费		
------	--	--

注：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的 0.8% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

管理费的计算方法如下： $H=E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,069.20	23,344.16

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，每日计提，按月支付。

托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,001,700.00	10,001,700.00
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	10,001,700.00	10,001,700.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	54.52%	53.40%
-----------------------	--------	--------

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。

#### 6.4.7.4.2 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持有本基金。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金的银行存款存放在托管人国泰君安在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期内及上年度可比期间均无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

#### 6.4.7.6 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由关联方承销的证券。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 6.4.8 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 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

#### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 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。

##### 6.4.8.3.2 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。

## § 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	20,334,877.96	93.58
	其中：股票	20,334,877.96	93.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,278,067.75	5.88
8	其他各项资产	116,364.95	0.54
9	合计	21,729,310.66	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 20,334,877.96 元，占资产净值比例 94.31%，本基金未通过深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 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 (%)
A 基础材料	349,779.20	1.62
B 消费者非必需品	1,476,518.11	6.85
C 消费者常用品	572,350.78	2.65
D 能源	771,584.98	3.58
E 金融	7,848,625.62	36.40
F 医疗保健	558,773.23	2.59
G 工业	1,300,137.47	6.03
H 信息技术	3,325,361.10	15.42
I 电信服务	872,257.66	4.05
J 公用事业	1,102,924.15	5.11



K 房地产	2,156,565.66	10.00
合计	20,334,877.96	94.31

注：以上分类采用全球行业标准（GICS）。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	00700	腾讯控股	9,900	3,070,664.35	14.24
2	00005	汇丰控股	26,400	1,504,851.96	6.98
3	01299	友邦保险	20,000	1,482,227.10	6.87
4	00939	建设银行	199,000	1,178,102.25	5.46
5	02318	中国平安	10,000	825,121.08	3.83
6	01398	工商银行	144,000	722,024.93	3.35
7	00001	长和	9,500	643,471.29	2.98
8	00941	中国移动	9,500	594,584.19	2.76
9	00016	新鸿基地产	4,500	524,497.28	2.43
10	00388	香港交易所	2,100	509,481.48	2.36

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。

#### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

### 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	00700	腾讯控股	398,581.41	1.75
2	02888	渣打集团	320,024.34	1.41
3	01918	融创中国	291,331.80	1.28
4	02313	申洲国际	274,390.91	1.21
5	00288	万洲国际	248,543.24	1.09
6	02314	理文造纸	116,361.60	0.51
7	00788	中国铁塔	114,599.07	0.50

8	02318	中国平安	111,655.80	0.49
9	00005	汇丰控股	90,417.25	0.40
10	00001	长和	68,918.58	0.30
11	00939	建设银行	51,252.14	0.23
12	01093	石药集团	49,556.35	0.22
13	01299	友邦保险	46,150.48	0.20
14	01177	中国生物制药	42,684.39	0.19
15	01398	工商银行	34,673.90	0.15
16	00941	中国移动	34,403.56	0.15
17	01928	金沙中国有限公司	25,405.77	0.11
18	03333	中国恒大	24,127.92	0.11
19	00669	创科实业	21,775.02	0.10
20	00388	香港交易所	20,476.44	0.09

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00005	汇丰控股	849,181.73	3.73
2	00700	腾讯控股	547,870.18	2.41
3	01299	友邦保险	303,197.72	1.33
4	00175	吉利汽车	297,441.63	1.31
5	00939	建设银行	281,738.17	1.24
6	00291	华润啤酒	220,060.32	0.97
7	00066	港铁公司	200,398.58	0.88
8	01288	农业银行	197,523.64	0.87
9	01398	工商银行	174,701.05	0.77
10	00656	复星国际	172,306.47	0.76
11	00267	中信股份	162,142.05	0.71
12	00941	中国移动	141,907.11	0.62
13	00586	海螺创业	114,739.13	0.50
14	03988	中国银行	101,293.87	0.45
15	03323	中国建材	94,560.92	0.42
16	00388	香港交易所	93,194.72	0.41
17	00003	香港中华煤气	77,478.14	0.34
18	02318	中国平安	75,252.80	0.33
19	00001	长和	71,957.24	0.32

20	00883	中国海洋石油	60,079.64	0.26
----	-------	--------	-----------	------

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，不考虑其它交易费用。

### 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	2,542,679.87
卖出股票收入（成交）总额	4,957,470.26

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名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。

### 7.8 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

注：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

注：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

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，工商银行于 2018 年 11 月 19 日受到中国保险监督管理委员会北京监管局作出的京保监罚〔2018〕28 号处罚决定，经查，中国工商银行股份有限公司存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，违反了《中华人民共和国保险法》第一百三十一条的规定，根据该法第一百六十五条的规定，决定对公司处以罚款 30 万元的行政处罚，并责令改正违法行为。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	109,698.20
4	应收利息	679.79

5	应收申购款	5,986.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,364.95

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五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进行积极投资。

#### 7.12.6 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
1,728	10,616.57	10,001,700.00	54.52%	8,343,733.51	45.48%

### 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

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,700.00	54.52	10,001,700.00	54.52	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,700.00	54.52	10,001,700.00	54.52	不少于 3 年

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 15 日）基金份额总额	17,101,684.96
本报告期期初基金份额总额	20,246,716.04
本报告期期间基金总申购份额	2,842,211.92
减：本报告期期间基金总赎回份额	4,743,494.45
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	18,345,433.51

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2019 年 3 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在指定信息披露媒体发布相应公告。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
申港证券	1	7,500,150.13	100.00%	3,000.11	100.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-



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。

## § 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	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	10,001,700.00	0.00	0.00	10,001,700.00	54.52%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 27 日