

长信易进混合型证券投资基金（原长信纯
债半年债券型证券投资基金）
2019 年第 4 季度报告

2019 年 12 月 31 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

报告送出日期：2020 年 1 月 17 日

§1 重要提示

长信易进混合型证券投资基金由长信纯债半年债券型证券投资基金转型而来。基金管理人于 2019 年 10 月 16 日起至 2019 年 10 月 27 日期间召开长信纯债半年债券型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于长信纯债半年债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过，决议于 2019 年 10 月 28 日生效。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次基金份额持有人大会表决通过后，修改后的《长信易进混合型证券投资基金基金合同》生效前，长信纯债半年债券型证券投资基金将安排不少于 20 个工作日的选择期供基金份额持有人做出选择，本基金选择期为 2019 年 10 月 31 日至 2019 年 11 月 27 日。自本次基金份额持有人大会决议生效后，选择期结束之日的次日（2019 年 11 月 28 日）起，《长信易进混合型证券投资基金基金合同》生效，《长信纯债半年债券型证券投资基金基金合同》同时失效。

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2020 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长信易进混合
基金主代码	003126
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 28 日

报告期末基金份额总额	44,003,204.21 份	
投资目标	通过积极主动的资产管理,在严格控制基金资产风险的前提下,力争为投资者提供稳定增长的投资收益。	
投资策略	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,开展战略资产配置,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。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	长信易进混合 A	长信易进混合 C
下属分级基金的交易代码	003126	003127
报告期末下属分级基金的份额总额	24,838.03 份	43,978,366.18 份

转型前:

基金简称	长信纯债半年债券	
基金主代码	003126	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 23 日	
报告期末基金份额总额	3,467,408.64 份	
投资目标	本基金在严格控制风险和有效保持资产流动性的前提下,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	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,适时调整组合久期,以获得基金资产的稳定增值,提高基金总体收益率。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C

下属分级基金的交易代码	003126	003127
报告期末下属分级基金的份额总额	85,764.88 份	3,381,643.76 份

注：上表中“报告期期末”为 2019 年 11 月 27 日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019 年 11 月 28 日 — 2019 年 12 月 31 日）	
	长信易进混合 A	长信易进混合 C
1. 本期已实现收益	49.71	79,793.06
2. 本期利润	218.64	160,747.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0032	0.0056
4. 期末基金资产净值	27,412.68	48,119,300.35
5. 期末基金份额净值	1.1037	1.0942

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为 2019 年 11 月 28 日，截至本报告期末，本基金运作未
满一个季度；

2、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；

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019 年 10 月 1 日 — 2019 年 11 月 27 日）	
	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C
1. 本期已实现收益	1,045.84	53,115.68
2. 本期利润	29.91	-19,888.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0003	-0.0025
4. 期末基金资产净值	94,260.26	3,683,350.86
5. 期末基金份额净值	1.0991	1.0892

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（转型后）

3.2.1 本报告期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

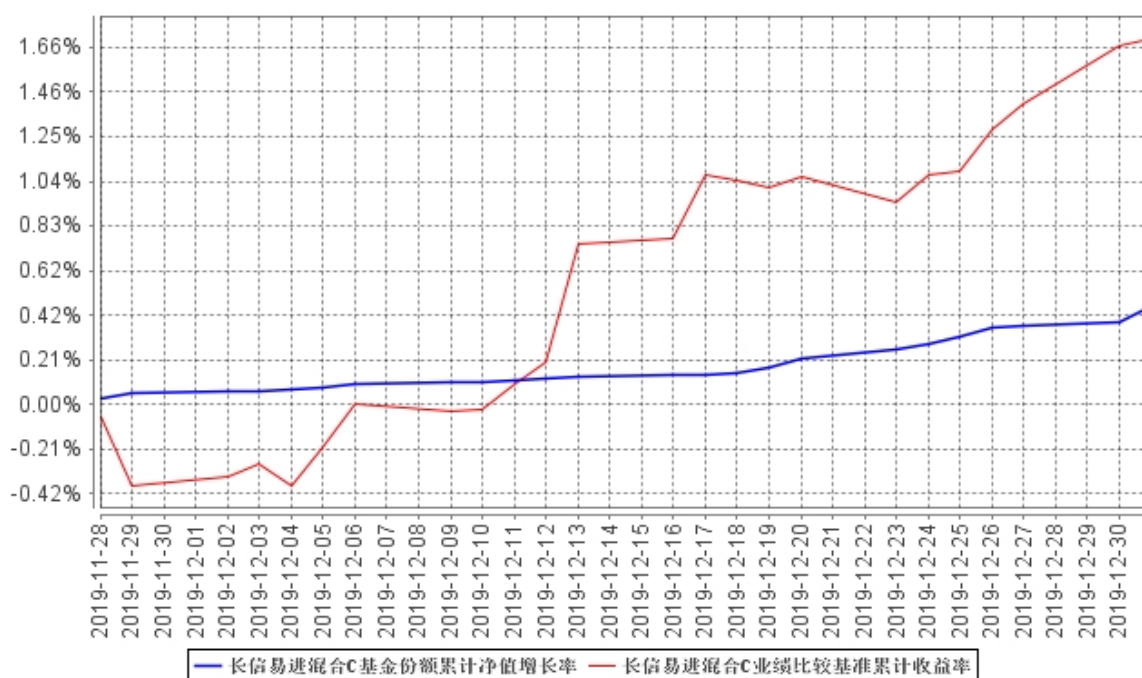
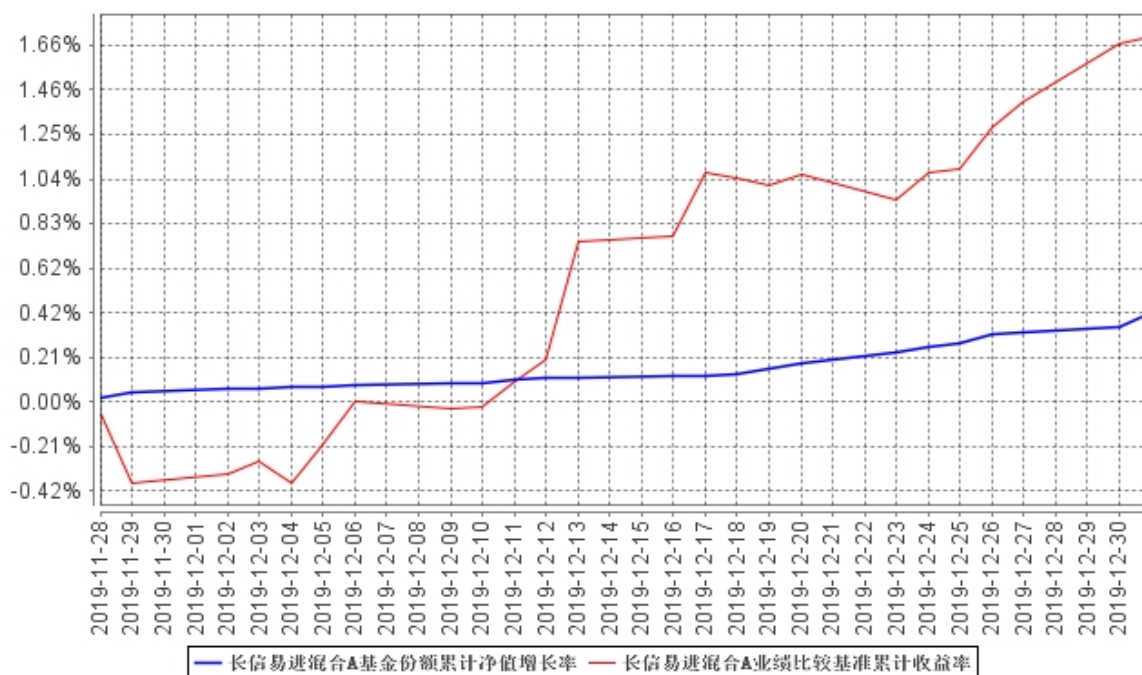
长信易进混合 A

阶段	净值增长率 ①	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
自转型 生效日 起至今 (2019 年11月 28日 -2019 年12月 31日)	0.42%	0.02%	1.71%	0.17%	-1.29%	-0.15%

长信易进混合 C

阶段	净值增长 率①	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
自转型生效 日起至今 (2019年11 月28日 -2019年12 月31日)	0.46%	0.02%	1.71%	0.17%	-1.25%	-0.15%

3.2.2 自基金转型以来基金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、转型后的本基金合同生效日为 2019 年 11 月 28 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 2019 年 11 月 28 日至 2019 年 12 月 31 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，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应

当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（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。国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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

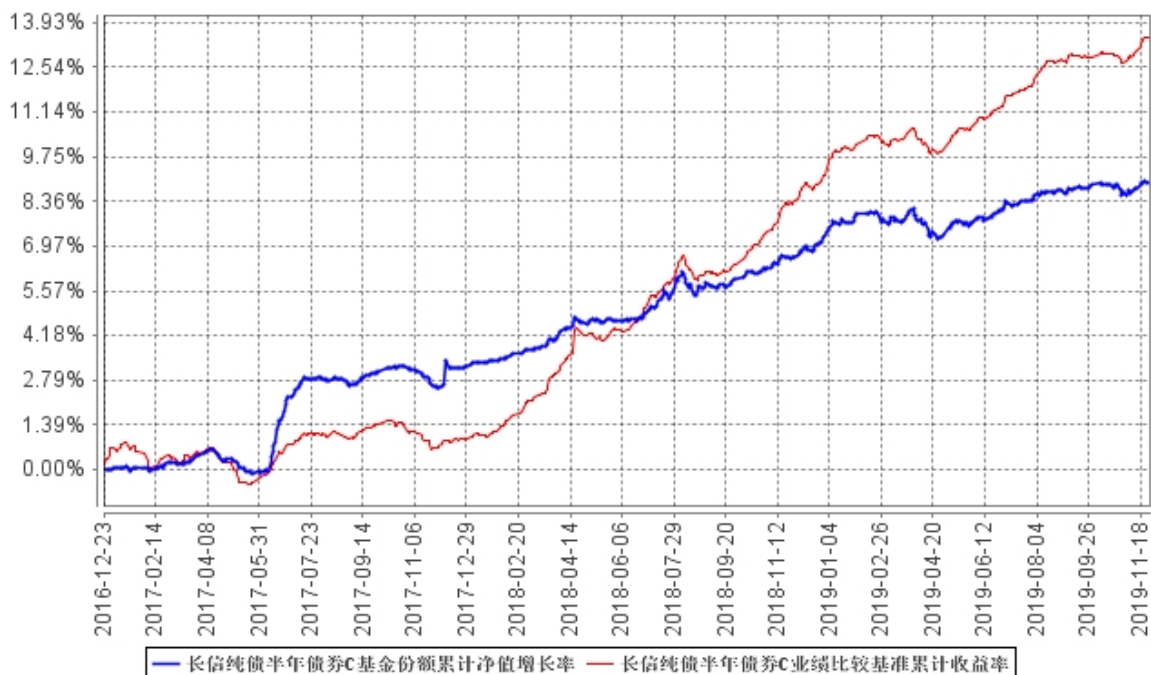
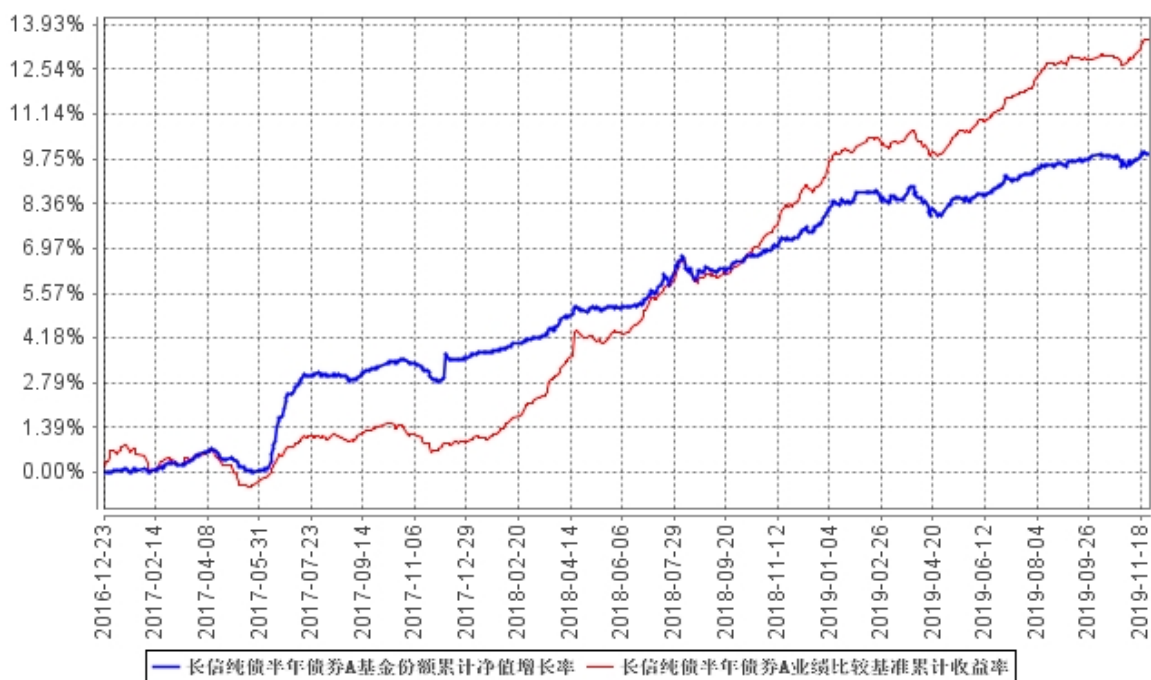
长信纯债半年债券 A

阶段	净值增长率①	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
2019 年 10 月 1 日-2019 年 11 月 27 日（基金合同失效前日）	0.05%	0.05%	0.54%	0.04%	-0.49%	0.01%

长信纯债半年债券 C

阶段	净值增长率①	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
2019 年 10 月 1 日-2019 年 11 月 27 日（基金合同失效前日）	0.01%	0.05%	0.54%	0.04%	-0.53%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 23 日至 2019 年 11 月 27 日（基金合同失效前日）。

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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监	2017年1月12日	2019年11月27日	9年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混	2019年11月28日	-	9年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，

	合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监			曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信纯债半年债券型证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、自2019年11月28日起，长信纯债半年债券型证券投资基金转型为长信易进混合型证券投资基金，陆莹仍担任该基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾四季度，债券市场收益率呈现先上后下趋势，3 年期以内利率债收益下行明显，5-7 年期利率小幅走低，10 年期利率比三季度末上行 5bp 左右。十月市场先是对通胀担忧持续发酵，预期经济短期有复苏迹象，叠加贸易战达成阶段性协议，机构保持谨慎态度，债券收益率持续上行。后随央行超预期下调 MLF 和 OMO 利率 5BP，大力呵护跨年流动性，整体资金面充裕，且保险、年金、摊余成本法基金的配置需求较强，中短期债券收益率逐步下行，长端受经济基本面制约收益率呈现窄幅震荡走势。在四季度中，我们灵活运用杠杆，参与债券波段操作，保持了组合净值的稳定增长。

4.4.2 2020 年一季度市场展望和投资策略

展望 2020 年，在稳增长目标下，货币政策仍有一定的放松空间，一月初央行宣布降准 0.5%，后续可能还有定向降准，鼓励银行对三农小微企业的信贷投放；价格方面为了配合 LPR 改革，有效降低企业中长期贷款成本，MLF 和 OMO 利率可能会有 15-20BP 的下调。同时一季度地方专项债将大量发行，经济大概率能够短期企稳，CPI 可能维持较高水平，预计债券市场整体仍处于震荡行情。未来我们将适时调整利率债和高等级信用债投资比例，积极把握债券市场调整带来的投资机会，为投资者争取更好的组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年12月31日，长信易进混合A份额净值为1.1037元，份额累计净值为1.1037元；长信易进混合C份额净值为1.0942元，份额累计净值为1.0942元。本报告期内转型前长信纯债半年债券A净值增长率为0.05%，长信纯债半年债券C净值增长率为0.01%，同期业绩比较基准收益率为0.54%；本报告期内转型后长信易进混合A净值增长率为0.42%，长信易进混合C净值增长率为0.46%，同期业绩比较基准收益率为1.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2017年12月7日至2018年3月6日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万元，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。截至2019年11月27日长信纯债半年债券型证券投资基金基金合同失效前日，本基金资产净值仍低于五千万元。自2019年11月28日长信易进混合型证券投资基金合同生效日至2019年12月25日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,966,490.00	49.74
	其中：债券	23,966,490.00	49.74
	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	17,771,263.66	36.88
	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	6,024,135.63	12.50
8	其他资产	419,012.04	0.87
9	合计	48,180,901.33	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,966,490.00	49.78
	其中：政策性金融债	23,966,490.00	49.78
4	企业债券	-	-
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	23,966,490.00	49.78

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018061	进出 1911	130,000	13,005,200.00	27.01
2	018006	国开 1702	100,000	10,255,000.00	21.30
3	018009	国开 1803	6,500	706,290.00	1.47

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,069.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	416,942.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	419,012.04

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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持有股票。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,380,910.00	88.81
	其中：债券	3,380,910.00	88.81
	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	349,152.98	9.17

8	其他资产	76,805.80	2.02
9	合计	3,806,868.78	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,380,910.00	89.50
	其中：政策性金融债	3,380,910.00	89.50
4	企业债券	-	-
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	3,380,910.00	89.50

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	26,000	2,652,780.00	70.22
2	018007	国开 1801	4,000	402,480.00	10.65
3	018009	国开 1803	3,000	325,650.00	8.62

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,154.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,651.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,805.80

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	长信易进混合 A	长信易进混合 C
基金合同生效日（2019 年 11 月 28 日） 基金份额总额	85,764.88	3,381,643.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	-	43,950,580.51
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	60,926.85	3,353,858.09
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	24,838.03	43,978,366.18

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	长信纯债半年债券 A	长信纯债半年债券 C
报告期期初基金份额总额	95,763.41	5,851,087.68
报告期期间基金总申购份额	-	6,428,409.40
减：报告期期间基金总赎回份额	9,998.53	8,897,853.32
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	85,764.88	3,381,643.76

注：上表中“报告期期末”为 2019 年 11 月 27 日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 12 月 3 日至 2019 年 12 月 31 日	0.00	9,175,153.68	0.00	9,175,153.68	20.85%
个人	1	2019 年 10 月 14 日至 2019 年 10 月 31 日	0.00	2,755,326.97	2,755,326.97	0.00	0.00%
	2	2019 年 10 月 9 日至 2019 年 10 月 13 日； 2019 年 11 月 1 日至 2019 年 11 月 3 日	0.00	2,111,253.90	2,111,253.90	0.00	0.00%
	3	2019 年 12 月 3 日至 2019 年 12 月 31 日	0.00	9,175,153.68	0.00	9,175,153.68	20.85%

		月 31 日					
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>							

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信纯债半年债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信纯债半年债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信纯债半年债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《长信易进混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长信易进混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《长信易进混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 9、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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限公司

2020 年 1 月 17 日