

长信价值优选混合型证券投资基金（原长
信中证能源互联网主题指数型证券投资基
金（LOF）转型）
2019 年年度报告

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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

长信价值优选混合型证券投资基金由长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型而来。基金管理人于 2019 年 1 月 2 日 0:00 起至 2019 年 1 月 18 日 17:00 止以通讯方式召开了长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，审议《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）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 1 月 21 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《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效前，长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）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 1 月 22 日至 2019 年 2 月 25 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 2 月 26 日）起，《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效，《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时失效。

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 2020 年 4 月 23 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 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（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	21
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	22
§6 审计报告（转型后）	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
§6 审计报告（转型前）	25
6.1 审计报告基本信息	25
6.2 审计报告的基本内容	25
§7 年度财务报表（转型后）	27
7.1 资产负债表（转型后）	27
7.2 利润表	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	29
7.4 报表附注	30

§7 年度财务报表（转型前）	54
7.1 资产负债表（转型前）	54
7.2 利润表	55
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	56
7.4 报表附注	57
§8 投资组合报告（转型后）	80
8.1 期末基金资产组合情况	80
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	80
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	81
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	85
8.6 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	85
8.7 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	85
8.8 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	86
8.9 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	86
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.12 投资组合报告附注	86
§8 投资组合报告（转型前）	88
8.1 期末基金资产组合情况	88
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	88
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	89
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
8.6 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	92
8.7 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	92
8.8 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	92
8.9 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	92
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
8.12 投资组合报告附注	93
§9 基金份额持有人信息（转型后）	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	95
9.3 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	95
§9 基金份额持有人信息（转型前）	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
9.2 期末上市基金前十名持有人	96
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
9.4 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	96
§10 开放式基金份额变动(转型后)	97
§10 开放式基金份额变动(转型前)	98
§11 重大事件揭示	99
11.1 基金份额持有人大会决议	99
11.2 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	99

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	99
11.4 基金投资策略的改变.....	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	101
11.9 其他重大事件（转型后）.....	101
11.9 其他重大事件（转型前）.....	104
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	106
12.1 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	106
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	107
§13 备查文件目录.....	108
13.1 备查文件目录.....	108
13.2 存放地点.....	108
13.3 查阅方式.....	108

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长信价值优选混合型证券投资基金
基金简称	长信价值优选混合
基金主代码	501002
交易代码	501002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 26 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	148,388,615.98 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	长信中证能源互联网指数（LOF）
场内简称	能源互联
基金主代码	501002
交易代码	501002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 21 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	7,624,198.80 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 2 月 1 日

注：上表中“报告期期末”为 2019 年 2 月 25 日。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和优质债券进行投资，力争以较低的风险获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
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，并追求稳健的收益。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
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，按照成份股在中证能源互联网主题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%×中证能源互联网主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	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

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址	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
邮政编码	200120	200041
法定代表人	成善栋	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31日
本期已实现收益	17,508,776.36
本期利润	26,720,813.53
加权平均基金份额本期利润	0.2136
本期加权平均净值利润率	26.90%
本期基金份额净值增长率	25.98%
3.1.2 期末数据和指标	2019年12月31日
期末可供分配利润	-19,217,764.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1295
期末基金资产净值	129,170,851.58
期末基金份额净值	0.8705
3.1.3 累计期末指标	2019年12月31日
基金份额累计净值增长率	25.98%

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2019年2月26日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

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。

4、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。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日至 2019年2月25日	2018年	2017年
本期已实现收益	-339,597.06	-395,993.57	82,322.66
本期利润	598,430.30	-1,204,731.80	-335,761.28
加权平均基金份额本期利润	0.0760	-0.3642	-0.0729
本期加权平均净值利润率	11.77%	-49.14%	-7.23%
本期基金份额净值增长率	12.54%	-37.85%	-5.54%
3.1.2 期末数据和指标	2019年2月25日	2018年末	2017年末
期末可供分配利润	-2,358,026.35	-3,111,876.29	-40,549.28
期末可供分配基金份额利润	-0.3093	-0.3858	-0.0123
期末基金资产净值	5,266,172.45	4,954,164.20	3,250,335.19

期末基金份额净值	0.691	0.614	0.988
3.1.3 累计期末指标	2019 年 2 月 25 日	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-30.90%	-38.60%	-1.20%

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、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。

3.2 基金净值表现（转型后）

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
过去三个月	9.10%	0.44%	5.85%	0.55%	3.25%	-0.11%
过去六个月	14.37%	0.68%	6.04%	0.64%	8.33%	0.04%
自转型生效 日起至今 (2019 年 2 月 26 日 -2019 年 12 月 31 日)	25.98%	0.79%	8.54%	0.89%	17.44%	-0.10%

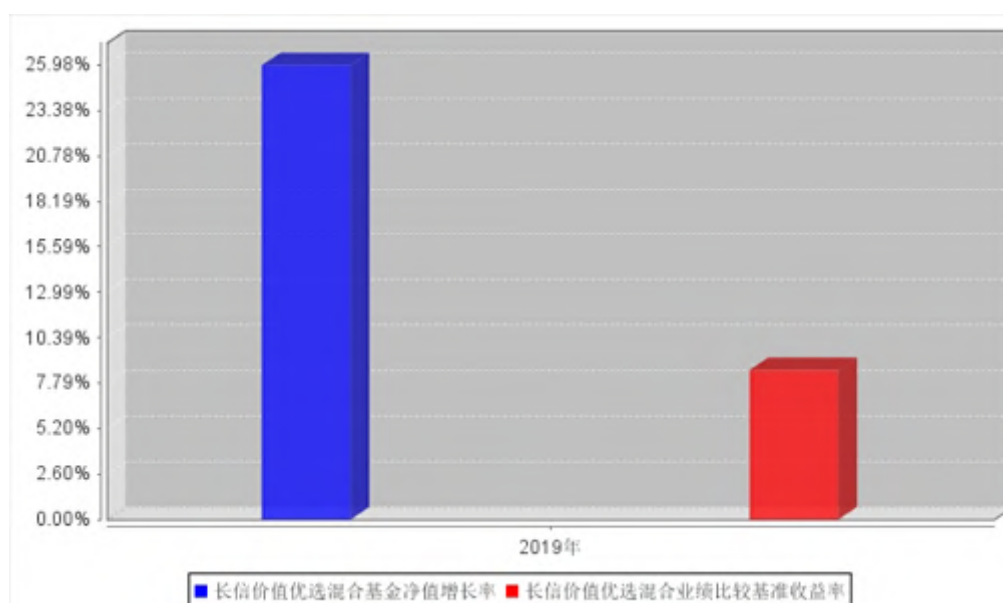
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2019年2月26日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿一年。图示日期为2019年2月26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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束未滿一年；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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



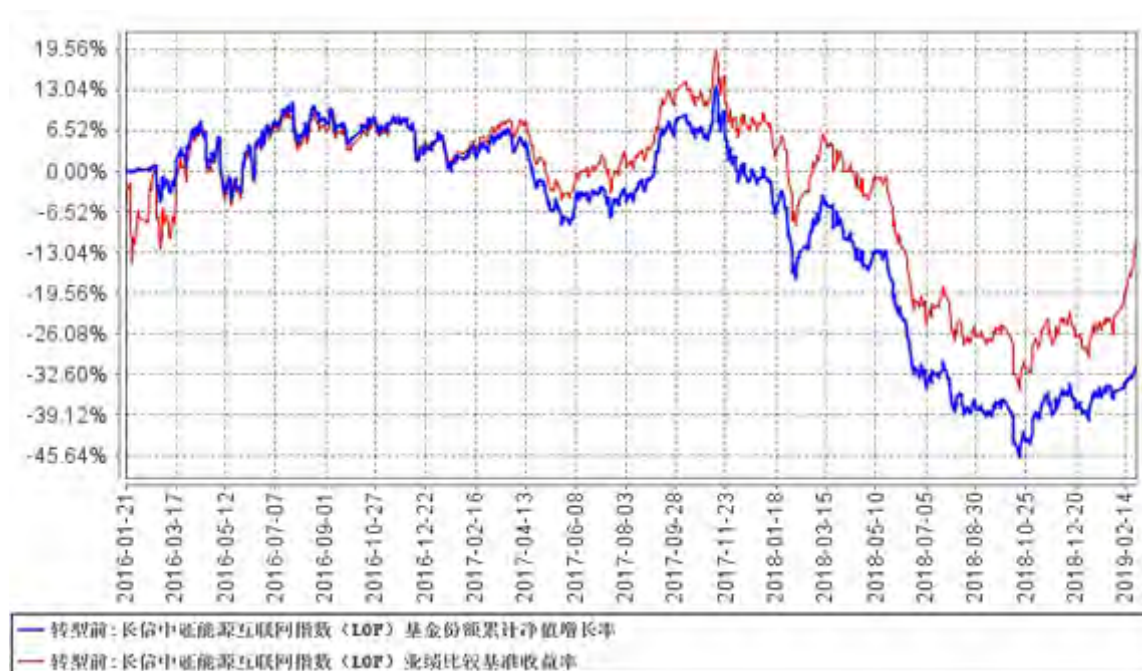
注：本基金基金合同生效日为2019年2月26日，2019年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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
过去一年 (2019 年 1 月 1 日-2019 年 2 月 25 日)	12.54%	1.21%	25.24%	1.63%	-12.70%	-0.42%
过去三年 (2017 年 1 月 1 日-2019 年 2 月 25 日)	-33.94%	1.27%	-14.07%	1.28%	-19.87%	-0.01%
自基金合同生效起至基金合同失效前日(2016 年 1 月 21 日-2019 年 2 月 25 日)	-30.90%	1.25%	-10.31%	1.43%	-20.59%	-0.18%

3.2.2 自基金合同生效至转型前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

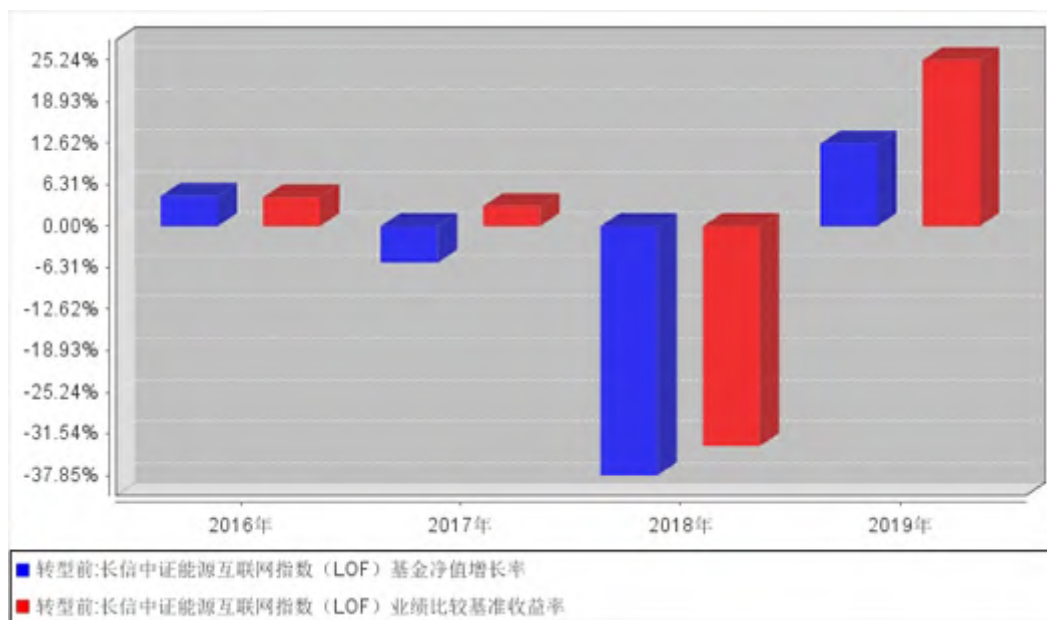


注：1、图示日期为 2016 年 1 月 21 日至 2019 年 2 月 25 日（基金合同失效前日）。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 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。

3.2.3 自基金合同生效至转型前每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2016年1月21日，本基金基金合同失效前日为2019年2月25日，2016年和2019年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：本基金基金合同生效日为2016年1月21日，本基金基金合同生效日起至2019年2月25日（基金合同失效前日）未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金基金合同生效日为2019年2月26日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§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）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 66 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、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进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（转型后）

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		
吴晖	长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 4 月 30 日	—	4 年	清华大学管理科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司和东方证券股份有限公司。2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司基金经理助理，现任长信价值优选混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
吴廷华	长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两	2019 年 2 月 26 日	—	8 年	经济学硕士，上海财经大学金融学硕士专业毕业，具有基金从业资格，曾任职于上海简适投资管理事务所、长城基金管理有限

	年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信价值优选混合型证券投资基金的基金经理				公司、建信人寿保险有限公司、安信基金管理有限公司、上海朴易资产管理有限公司。2016年加入长信基金管理有限责任公司，曾任研究发展部研究员，现任长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信价值优选混合型证券投资基金的基金经理。
宋海岸	曾任本基金的基金经理	2019年2月26日	2019年5月6日	5年	曾任本基金的基金经理

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2月26日起，长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型为长信价值优选混合型证券投资基金，宋海岸仍担任该基金的基金经理；

4、自2020年3月31日起，吴廷华不再担任该基金的基金经理。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
宋海岸	长信中证500指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信价值优选混合型证券投资基金和长信先优债券型证券投资基金的基金经理	2018年3月17日	2019年2月25日	5年	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016年9月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理，现任长信中证500指数增强型证券投资基金、长信

					国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信价值优选混合型证券投资基金和长信先优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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

（1）严格按照时间顺序发送委托指令；

（2）对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5：1 或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形

式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

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 年海外市场，中美贸易冲突先持续升级后显著缓和，美联储年内三次降息，美国经济总体缓中有韧性，欧元区经济疲弱中有企稳迹象。国内市场，经济增速继续下行，内外需同步回落。制造业投资和消费是拖累内需的主要因素，贸易摩擦对出口的影响体现出来。在此背景下，工业品价格指数和核心通胀持续回落，但 CPI 三季度以来受猪肉价格拉动而回升，呈现出结构性通胀。货币政策方面，央行两次全面降准，三次定向降准，资金面较充裕，但资金价格中枢的波动性较大，金融供给侧改革保持推进，社会融资增速企稳略有上行。

19 年初以来市场对过于悲观预期进行了整体的修复，进入二季度以后结构有所分化，消费、电子、新能源等行业先后表现占优。本基金把握了年初的系统性行情，并且在下半年，逐步增加科技成长类仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年12月31日，本基金单位净值为0.8705元，累计单位净值0.8705元。本报告期内转型前本基金净值增长率为12.54%，同期业绩比较基准涨幅为25.24%；本报告期内转型后本基金净值增长率为25.98%，同期业绩比较基准涨幅为8.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年是政策目标实现的关键一年，稳增长的诉求较强，逆周期政策将会适时调节，预计全年经济增速小幅下行。具体在上半年，地产投资尚有韧性，制造业投资在库存周期转换下或有回升，基建投资预计延续回升的趋势。政策方面，上半年经济回升叠加通胀高位，货币政策宽松受到制约，但财政政策可能较为积极，下半年不排除在地产下行压力下再度宽松。中美方面，随着贸易协定的签订，出口不确定会下降。海外市场，美国经济在就业和消费，以及美联储降息和扩表等因素的作用下仍有支撑，但同时美国大选存不确定性，赤字水平维持扩张，美元可能走弱。

拉长周期来看，A股将持续迎来中长期配置资金，来自理财和社保的配置需求，以及对外开放等政策支持是推动长期资金入市的主因。另一方面，科创板设立、注册制推广等制度改革将会促进上市公司的优胜劣汰，打造更为成熟的资本市场。

我们将继续秉承谨慎原则，密切关注经济走势和政策动向，配置上延续寻找盈利向上的行业和公司，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险梳理的工作，及时组织召开内部控制委员会会议，对新规要求进行解读，并依照新规要求，对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨，并加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测的机制，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临

的风险进行沟通、讨论，防范系统性风险事件的发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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。

4.9 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

自 2016 年 2 月 4 日至 2016 年 5 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 2 月 25 日长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）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 2 月 26 日长信价值优选混合型证券投资基金合同生效日至 2019 年 5 月 22 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。自 2019 年 5 月 27 日起至报告期末，本基金资产净值高于五千万元。

§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”）在长信价值优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）（原长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF））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 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P00058 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信价值优选混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了长信价值优选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长信价值优选混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信价值优选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长信价值优选混合型证券投资基金 2019 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报

	表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信价值优选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信价值优选混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督长信价值优选混合型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信价值优选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信价值优选混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曾浩	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 22 日	

§6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P00033 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)全体持有人
审计意见	我们审计了长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)的财务报表,包括 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)2019 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报

	表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曾浩	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 22 日	

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	4,980,529.33
结算备付金		2,964,641.52
存出保证金		184,088.71
交易性金融资产	7.4.7.2	165,515,724.20
其中：股票投资		109,577,730.20
基金投资		-
债券投资		55,937,994.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,690,530.68
应收利息	7.4.7.5	1,045,147.56
应收股利		-
应收申购款		13,683.57
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		176,394,345.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		43,500,000.00
应付证券清算款		2,274,524.93
应付赎回款		1,112,283.56
应付管理人报酬		162,102.98
应付托管费		10,806.88
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	133,323.93
应交税费		-
应付利息		-3,597.94

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	34,049.65
负债合计		47,223,493.99
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	148,388,615.98
未分配利润	7.4.7.10	-19,217,764.40
所有者权益合计		129,170,851.58
负债和所有者权益总计		176,394,345.57

注：1、报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.8705 元，基金份额总额 148,388,615.98 份。

2、本基金本报告期为 2019 年 2 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日，转型后的基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		29,432,565.64
1. 利息收入		1,506,094.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	134,291.80
债券利息收入		1,371,431.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		371.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,430,539.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,257,971.56
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-36,740.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	2,209,308.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.17	9,212,037.17

填列)		
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	283,894.60
减：二、费用		2,711,752.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,265,214.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	84,347.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	839,033.38
5. 利息支出		497,739.35
其中：卖出回购金融资产支出		497,739.35
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	25,417.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,720,813.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,720,813.53

注：本基金本报告期为 2019 年 2 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日，转型后的基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 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)	7,624,198.80	-2,358,026.35	5,266,172.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,720,813.53	26,720,813.53
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)	140,764,417.18	-43,580,551.58	97,183,865.60
其中：1. 基金申购款	225,120,670.13	-60,047,632.65	165,073,037.48
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-84,356,252.95	16,467,081.07	-67,889,171.88
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)	148,388,615.98	-19,217,764.40	129,170,851.58

注：本基金本报告期为 2019 年 2 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日，转型后的基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日正式生效，为报告期内合同生效的基金，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 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信价值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“长信中证能源互联网指数(LOF)”)转型而成。长信中证能源互联网指数(LOF)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》、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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]2703 号文准予公开募集注册，于 2016 年 1 月 21 日募集成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 242,530,801.91 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验字第 1600092 号验资报告。长信中证能源互联网指数(LOF)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。

本基金于 2019 年 1 月 2 日起至 2019 年 1 月 18 日止期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会审议了《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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 1 月 21 日生效。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)变更为长信价值优选混合型证券投资基金，修订后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2019 年 2 月 26 日生效。本基金的基金管理人和基金托管人保持不变。

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《长信价值优选混合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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、

港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货、股票期权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。本基金的投资组合为:股票资产占基金资产的 50%-95%,投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%;本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权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。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 25%。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

— 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

— 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

— 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 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，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24 号），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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续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的公告》、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；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，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，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	4,980,529.33
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	4,980,529.33

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	100,081,679.94	109,577,730.20	9,496,050.26
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	55,938,604.56	55,937,994.00
	银行间市场	—	—
	合计	55,938,604.56	55,937,994.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	156,020,284.50	165,515,724.20	9,495,439.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,807.29
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	1,372.99
应收债券利息	1,040,825.84
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	141.44
合计	1,045,147.56

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	133,323.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	133,323.93

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,049.65
应付证券出借违约金	-

预提账户维护费	-
预提审计费	30,000.00
合计	34,049.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金转型起始日	7,624,198.80	7,624,198.80
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	225,120,670.13	225,120,670.13
本期赎回（以“-”号填列）	-84,356,252.95	-84,356,252.95
本期末	148,388,615.98	148,388,615.98

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型起始日	-86,289.16	-2,271,737.19	-2,358,026.35
本期利润	17,508,776.36	9,212,037.17	26,720,813.53
本期基金份额交易产生的变动数	2,469,189.87	-46,049,741.45	-43,580,551.58
其中：基金申购款	11,446,209.48	-71,493,842.13	-60,047,632.65
基金赎回款	-8,977,019.61	25,444,100.68	16,467,081.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,891,677.07	-39,109,441.47	-19,217,764.40

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	98,954.88
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	30,265.90
其他	5,071.02
合计	134,291.80

注：其他中存出保证金利息收入为 1,989.56 元，申购款利息收入为 3,081.46 元。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	258,511,040.38
减：卖出股票成本总额	242,253,068.82
买卖股票差价收入	16,257,971.56

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31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	-36,740.54
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	-36,740.54

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	70,258,266.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	68,889,555.84
减：应收利息总额	1,405,451.08
买卖债券差价收入	-36,740.54

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,209,308.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,209,308.54

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,212,037.17
——股票投资	9,212,722.73
——债券投资	-685.56
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	9,212,037.17

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019
----	--------------------------------------

	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	283,788.62
基金转换费收入	105.98
合计	283,894.60

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对持有期不少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	839,033.38
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	839,033.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	25,397.36
信息披露费	—
证券出借违约金	—
其他费用	20.00
合计	25,417.36

注：其他费用为托管户更名费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	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
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国泰君安	313,560,827.70	53.62%

注：转型后的本基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国泰君安	41,156,897.60	21.40%

注：转型后的本基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31日	
	回购成交金额	占当期回购债券成交总额的比例
国泰君安	3,822,200,000.00	86.63%

注：转型后的本基金基金合同于2019年2月26日起正式生效，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31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	255,164.47	56.26%	133,323.93	100.00%

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年2月26日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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。

3、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，还从国泰君安获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月26日(基金转型起始日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,265,214.38
其中：支付销售机构的客户维护费	45,368.91

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年2月26日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率确认，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×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 2 月 26 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,347.64

注：1、转型后的本基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、支付基金托管人国泰君安的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
长江财富	44,076,628.47	29.70%

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。

7.4.10.6 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；本基金本报告期内无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	说明
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	1,913	84,133.74	84,133.74	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年7月6日	新股流通受限	28.21	28.21	2,628	74,135.88	74,135.88	-
688002	睿创微纳	2019年7月4日	2020年1月22日	新股锁定	20.00	37.05	16,136	322,720.00	597,838.80	-
688018	乐鑫科技	2019年7月	2020年1	新股锁定	62.60	163.82	6,264	392,126.40	1,026,168.48	-

		12 日	月 22 日							
688022	瀚川智能	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	25.79	42.95	12,006	309,634.74	515,657.70	-
688088	虹软科技	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	28.88	45.75	14,967	432,246.96	684,740.25	-
688122	西部超导	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	15.00	32.80	15,715	235,725.00	515,452.00	-
688168	安博通	2019 年 8 月 30 日	2020 年 3 月 6 日	新股锁定	56.88	97.93	2,252	128,093.76	220,538.36	-
688363	华熙生物	2019 年 10 月 28 日	2020 年 5 月 6 日	新股锁定	47.79	72.00	8,820	421,507.80	635,040.00	-
688111	金山办公	2019 年 11 月 11 日	2020 年 5 月 18 日	新股锁定	45.86	128.63	14,659	672,261.74	1,885,587.17	-
688037	芯源微	2019 年 12 月 6 日	2020 年 6 月 16 日	新股锁定	26.97	58.98	3,028	81,665.16	178,591.44	-
688123	聚辰股份	2019 年 12 月 16 日	2020 年 6 月 23 日	新股锁定	33.25	58.12	2,960	98,420.00	172,035.20	-
688078	龙软科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 6 月 30 日	新股锁定	21.59	41.95	2,811	60,689.49	117,921.45	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 43,500,000.00 元，于 2020 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、流动性风险和市场风险。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理念，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。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，战略与产品研发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。

7.4.13.2 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同责任，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。本基金的银行存款由本基金的托管人国泰君安转存于中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	10,006,000.00
合计	10,006,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2019 年 12 月 31 日
AAA	—
AAA 以下	—
未评级	45,931,994.00
合计	45,931,994.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	4,980,529.33	-	-	-	-	4,980,529.33
结算备付金	2,964,641.52	-	-	-	-	2,964,641.52
存出保证金	184,088.71	-	-	-	-	184,088.71
交易性金融资产	10,006,000.00	19,671,437.50	26,260,556.50	-	109,577,730.20	165,515,724.20
应收证券清算款	-	-	-	-	1,690,530.68	1,690,530.68
应收利息	-	-	-	-	1,045,147.56	1,045,147.56
应收申购款	-	-	-	-	13,683.57	13,683.57
资产总计	18,135,259.56	19,671,437.50	26,260,556.50	-	112,327,092.01	176,394,345.57
负债						
卖出回购金融资 产款	43,500,000.00	-	-	-	-	43,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	2,274,524.93	2,274,524.93
应付赎回款	-	-	-	-	1,112,283.56	1,112,283.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	162,102.98	162,102.98
应付托管费	-	-	-	-	10,806.88	10,806.88
应付交易费用	-	-	-	-	133,323.93	133,323.93
应付利息	-	-	-	-	-3,597.94	-3,597.94
其他负债	-	-	-	-	34,049.65	34,049.65
负债总计	43,500,000.00	-	-	-	3,723,493.99	47,223,493.99
利率敏感度缺口	-25,364,740.44	19,671,437.50	26,260,556.50	-	-108,603,598.02	129,170,851.58

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。

7.4.13.4.1.2 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）
		本期末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 27 个基点	149,873.83
	市场利率上升 27 个基点	-149,873.83

7.4.13.4.2 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

金持有不以记账本位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。

截止于 2019 年 12 月 31 日，本基金所持有投资于香港股票市场的交易性金融资产，以港币计价，金额折合成人民币为 5,569,682.35 元。

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	109,577,730.20	84.83
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	55,937,994.00	43.31
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	165,515,724.20	128.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险	
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）
		本期末（2019 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.34%	-4,316,063.93

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

7.4.14 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

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 102,869,889.73 元，属于第二层次的余额为人民币 56,096,263.62 元，属于第三层次的余额为人民币 6,549,570.85 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的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应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

本期转入第三层次金额为人民币 0.00 元，转出第三层次金额为人民币 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额为人民币 3,394,479.80 元，本期购买金额为人民币 3,155,091.05 元，出售金额为人民币 0.00 元，本期末余额为人民币 6,549,570.85 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 3,394,479.80 元。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 2 月 25 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,757,212.83	2,884,552.19
结算备付金		6,056.91	1,212.36
存出保证金		3,228.56	490.37
交易性金融资产	7.4.7.2	2,565,615.76	4,054,316.87
其中：股票投资		2,415,645.76	4,054,316.87
基金投资		-	-
债券投资		149,970.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,022.43	661.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,097.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,337,136.49	6,943,330.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,788,417.59
应付赎回款		-	66,906.75
应付管理人报酬		2,061.08	1,412.25
应付托管费		446.56	305.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,742.65	1,873.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	65,713.75	130,250.35
负债合计		70,964.04	1,989,166.76
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,624,198.80	8,066,040.49
未分配利润	7.4.7.10	-2,358,026.35	-3,111,876.29
所有者权益合计		5,266,172.45	4,954,164.20
负债和所有者权益总计		5,337,136.49	6,943,330.96

注：报告截止日 2019 年 2 月 25 日，基金份额净值人民币 0.691 元，基金份额总额 7,624,198.80 份。

7.2 利润表

会计主体：长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		645,738.12	-963,383.01
1. 利息收入		4,237.33	9,033.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,981.01	3,937.28
债券利息收入		256.32	5,096.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-297,471.47	-165,146.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-297,285.42	-189,334.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-2,006.40
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-186.05	26,195.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	938,027.36	-808,738.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	944.90	1,468.10

列)			
减：二、费用		47,307.82	241,348.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,662.98	14,754.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,010.31	3,196.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,920.78	4,266.68
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	7.4.7.20	35,713.75	219,130.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		598,430.30	-1,204,731.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		598,430.30	-1,204,731.80

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 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）	8,066,040.49	-3,111,876.29	4,954,164.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	598,430.30	598,430.30
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）	-441,841.69	155,419.64	-286,422.05
其中：1. 基金申购款	628,910.26	-225,691.02	403,219.24
2. 基金赎回款	-1,070,751.95	381,110.66	-689,641.29
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）	7,624,198.80	-2,358,026.35	5,266,172.45
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	3,290,884.47	-40,549.28	3,250,335.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,204,731.80	-1,204,731.80
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）	4,775,156.02	-1,866,595.21	2,908,560.81
其中：1. 基金申购款	6,321,313.08	-2,235,456.10	4,085,856.98
2. 基金赎回款	-1,546,157.06	368,860.89	-1,177,296.17
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）	8,066,040.49	-3,111,876.29	4,954,164.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)（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》、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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]2703 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 242,530,801.91 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验字第 1600092 号验资报告。基金合同于 2016 年 1 月 21 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。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会审议了《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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 1 月 21 日生效。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)变更为长信价值优选混合型证券投资基金。修订后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 2 月 26 日生效。

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《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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，包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、资产支持证券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。本基金的投资组合为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的 90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指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)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证能源互联网主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率(税后)}$ 。

7.4.2 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。

2019 年 2 月 26 日本基金变更为长信价值优选混合型证券投资基金并继续运作，故而本财务报表仍按持续经营假设编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日（基金合同失效前日）止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报

酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相

互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

－ 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

－ 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

－ 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.13%的年费率逐日计提。

本基金的指数使用许可费按前一日基金资产净值 0.02%的年费率逐日计提。每季度累计金额不足 5 万元的，按 5 万元计提，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 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 6 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；场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定

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。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价

值计算模型进行估值。

2) 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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续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的公告》、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；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，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。

4)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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月25日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	2,757,212.83	2,884,552.19
定期存款	—	—
其中：存款期限1个月以内	—	—
存款期限1-3个月	—	—
存款期限3个月以上	—	—
其他存款	—	—
合计：	2,757,212.83	2,884,552.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月25日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,132,318.23	2,415,645.76	283,327.53
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	149,895.00	149,970.00
	银行间市场	—	—
	合计	149,895.00	149,970.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—

合计		2,282,213.23	2,565,615.76	283,402.53
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,708,941.70	4,054,316.87	-654,624.83
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,708,941.70	4,054,316.87	-654,624.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,549.52	613.19
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	41.36	0.55
应收债券利息	379.73	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	47.62	47.62
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	4.20	0.33
合计	5,022.43	661.69

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,742.65	1,873.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,742.65	1,873.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	250.35
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	34,602.64	30,000.00
预提信息披露费	-	50,000.00
应付指数使用基费	31,111.11	50,000.00
合计	65,713.75	130,250.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,066,040.49	8,066,040.49
本期申购	628,910.26	628,910.26
本期赎回（以“-”号填列）	-1,070,751.95	-1,070,751.95
- 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	7,624,198.80	7,624,198.80

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 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	263,409.21	-3,375,285.50	-3,111,876.29

本期利润	-339,597.06	938,027.36	598,430.30
本期基金份额交易产生的变动数	-10,101.31	165,520.95	155,419.64
其中：基金申购款	20,074.58	-245,765.60	-225,691.02
基金赎回款	-30,175.89	411,286.55	381,110.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-86,289.16	-2,271,737.19	-2,358,026.35

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,936.33	3,860.55
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	40.81	12.45
其他	3.87	64.28
合计	3,981.01	3,937.28

注：其他为存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,870,590.05	870,616.87
减：卖出股票成本总额	3,167,875.47	1,059,951.85
买卖股票差价收入	-297,285.42	-189,334.98

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	-	-2,006.40
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	-	-2,006.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月25日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	137,103.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	132,682.40
减：应收利息总额	-	6,427.20
买卖债券差价收入	-	-2,006.40

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月25日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	-186.05	26,195.22

其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-186.05	26,195.22

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	938,027.36	-808,738.23
——股票投资	937,952.36	-808,738.23
——债券投资	75.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	938,027.36	-808,738.23

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	944.90	1,468.10
合计	944.90	1,468.10

注：本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25%应归基金财产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5,920.78	4,266.68
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-

其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	5,920.78	4,266.68

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	4,602.64	30,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费_基点费	31,111.11	139,130.56
合计	35,713.75	219,130.56

注：按照国家有关规定和基金合同约定，本基金的指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率每日计提，逐日累计，按季支付。其计算公式为：日指数使用许可费=前一日基金资产净值×0.02%÷当年天数。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

除附注 7.4.1 部分所述，本基金自长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转换为长信价值优选混合型证券投资基金外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	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
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤骏”）	基金管理人的股东

投资”)	
上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司(以下简称“长江期货”)	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 2 月 25 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	2,111,695.10	61.00%	2,349,382.27	60.95%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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 2 月 25 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	1,755.38	64.00%	1,755.38	64.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	1,952.99	63.95%	1,165.06	62.17%

注：1、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。

2、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，还从国泰君安获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,662.98	14,754.75
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	401.44	1,742.42

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%的年费率确认，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×0.60%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 25 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,010.31	3,196.80

注：支付基金托管人国泰君安的基金托管费按前一日基金资产净值×0.13%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.13%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 2 月 25 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
长江财富	3,846,449.73	50.45%	3,846,449.73	47.69%

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。

7.4.10.6 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；本基金本报告期内无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 2 月 25 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、流动性风险和市场风险。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理念，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。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，战略与产品研发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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款由本基金的托管人国泰君安转存于中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 2 月 25 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	149,970.00	0.00
合计	149,970.00	0.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 2 月 25 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	2,757,212.83	-	-	-	-	-2,757,212.83
结算备付金	6,056.91	-	-	-	-	6,056.91

存出保证金	3,228.56	-	-	-	-	3,228.56
交易性金融资产	-	149,970.00	-	-	-2,415,645.76	2,565,615.76
应收利息	-	-	-	-	5,022.43	5,022.43
资产总计	2,766,498.30	149,970.00	-	-	-2,420,668.19	5,337,136.49
负债	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,061.08	2,061.08
应付托管费	-	-	-	-	446.56	446.56
应付交易费用	-	-	-	-	2,742.65	2,742.65
其他负债	-	-	-	-	65,713.75	65,713.75
负债总计	-	-	-	-	70,964.04	70,964.04
利率敏感度缺口	2,766,498.30	149,970.00	-	-	-2,349,704.15	5,266,172.45
上年度末 2018 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	2,884,552.19	-	-	-	-	-2,884,552.19
结算备付金	1,212.36	-	-	-	-	1,212.36
存出保证金	490.37	-	-	-	-	490.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-4,054,316.87	4,054,316.87
应收利息	-	-	-	-	661.69	661.69
应收申购款	-	-	-	-	2,097.48	2,097.48
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,886,254.92	-	-	-	-4,057,076.04	6,943,330.96
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-1,788,417.59	1,788,417.59
应付赎回款	-	-	-	-	66,906.75	66,906.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,412.25	1,412.25
应付托管费	-	-	-	-	305.96	305.96
应付交易费用	-	-	-	-	1,873.86	1,873.86
其他负债	-	-	-	-	130,250.35	130,250.35
负债总计	-	-	-	-	-1,989,166.76	1,989,166.76
利率敏感度缺口	2,886,254.92	-	-	-	-2,067,909.28	4,954,164.20

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。

7.4.13.4.1.2 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）	
		本期末（2019 年 2 月 25 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 27 个基点	354.26	0.00

市场利率上升 27 个基点	-354.26	0.00
---------------	---------	------

7.4.13.4.2 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。本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 2 月 25 日		上年度末 2018 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	2,415,645.76	45.87	4,054,316.87	81.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	149,970.00	2.85	—	—
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	2,565,615.76	48.72	4,054,316.87	81.84

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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）	
		本期末（2019 年 2 月 25 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 2.02%（2018 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.53%）	-106,368.40	-174,668.85

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2018 年的分析同样基于该假设。

7.4.14 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

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 2 月 25 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 2,415,645.76 元，属于第二层次的余额为人民币 149,970.00 元，无属于第三层次的余额(于 2018 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 4,054,316.87 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的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应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	109,577,730.20	62.12
	其中：股票	109,577,730.20	62.12
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	55,937,994.00	31.71
	其中：债券	55,937,994.00	31.71
	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	7,945,170.85	4.50
8	其他各项资产	2,933,450.52	1.66
9	合计	176,394,345.57	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 5,569,682.35 元，占资产净值比例为 4.31%，本基金未通过深港通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	3,113,658.00	2.41
C	制造业	39,308,010.79	30.43
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,839,757.50	1.42
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,934,955.71	3.05
J	金融业	45,443,669.00	35.18

K	房地产业	8,549,592.00	6.62
L	租赁和商务服务业	1,818,404.85	1.41
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	104,008,047.85	80.52

8.2.2 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	—	—
B 消费者非必需品	—	—
C 消费者常用品	—	—
D 能源	—	—
E 金融	—	—
F 医疗保健	1,288,095.81	1.00
G 工业	—	—
H 信息技术	4,281,586.54	3.31
I 电信服务	—	—
J 公用事业	—	—
K 房地产	—	—
合计	5,569,682.35	4.31

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	107,300	9,169,858.00	7.10
2	601398	工商银行	1,545,600	9,088,128.00	7.04
3	601166	兴业银行	394,900	7,819,020.00	6.05
4	601939	建设银行	850,500	6,149,115.00	4.76
5	600030	中信证券	165,400	4,184,620.00	3.24
6	600887	伊利股份	134,600	4,164,524.00	3.22
7	601601	中国太保	96,600	3,655,344.00	2.83
8	601818	光大银行	761,800	3,359,538.00	2.60
9	600048	保利地产	192,400	3,113,032.00	2.41

10	002311	海大集团	80,000	2,880,000.00	2.23
11	600383	金地集团	198,500	2,878,250.00	2.23
12	000063	中兴通讯	76,200	2,696,718.00	2.09
13	000858	五粮液	19,700	2,620,297.00	2.03
14	000002	万科 A	79,500	2,558,310.00	1.98
15	600276	恒瑞医药	28,700	2,511,824.00	1.94
16	600760	中航沈飞	79,200	2,502,720.00	1.94
17	600309	万华化学	44,200	2,482,714.00	1.92
18	002475	立讯精密	64,100	2,339,650.00	1.81
19	600486	扬农化工	31,200	2,141,256.00	1.66
20	600583	海油工程	286,100	2,111,418.00	1.63
21	600036	招商银行	53,700	2,018,046.00	1.56
22	600196	复星医药	73,900	1,965,740.00	1.52
23	000651	格力电器	29,300	1,921,494.00	1.49
24	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	1.46
25	600009	上海机场	23,362	1,839,757.50	1.42
26	601888	中国国旅	20,443	1,818,404.85	1.41
27	603983	丸美股份	28,400	1,704,852.00	1.32
28	600585	海螺水泥	30,900	1,693,320.00	1.31
29	600104	上汽集团	69,043	1,646,675.55	1.27
30	01951	锦欣生殖	138,000	1,288,095.81	1.00
31	600600	青岛啤酒	24,300	1,239,300.00	0.96
32	02382	舜宇光学科技	9,700	1,172,155.00	0.91
33	00981	中芯国际	106,500	1,139,082.81	0.88
34	600031	三一重工	66,400	1,132,120.00	0.88
35	00268	金蝶国际	157,000	1,095,565.81	0.85
36	688018	乐鑫科技	6,264	1,026,168.48	0.79
37	601808	中海油服	52,200	1,002,240.00	0.78
38	00700	腾讯控股	2,600	874,782.92	0.68
39	601799	星宇股份	9,200	873,816.00	0.68
40	688088	虹软科技	14,967	684,740.25	0.53
41	688363	华熙生物	8,820	635,040.00	0.49
42	688002	睿创微纳	16,136	597,838.80	0.46
43	688022	瀚川智能	12,006	515,657.70	0.40
44	688122	西部超导	15,715	515,452.00	0.40
45	688168	安博通	2,252	220,538.36	0.17
46	688037	芯源微	3,028	178,591.44	0.14
47	688123	聚辰股份	2,960	172,035.20	0.13
48	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.09

49	688181	八亿时空	1,913	84,133.74	0.07
50	688081	兴图新科	2,628	74,135.88	0.06
51	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	14,956,087.00	11.58
2	600027	华电国际	14,346,938.64	11.11
3	601939	建设银行	12,596,482.91	9.75
4	601166	兴业银行	11,991,183.00	9.28
5	600377	宁沪高速	11,066,963.44	8.57
6	601318	中国平安	10,846,768.89	8.40
7	601288	农业银行	10,064,460.00	7.79
8	600036	招商银行	9,654,870.70	7.47
9	600030	中信证券	8,898,158.00	6.89
10	601988	中国银行	8,495,260.00	6.58
11	601328	交通银行	7,867,361.00	6.09
12	600900	长江电力	7,337,600.69	5.68
13	600887	伊利股份	7,169,311.23	5.55
14	600011	华能国际	7,151,349.78	5.54
15	600583	海油工程	6,264,382.00	4.85
16	601688	华泰证券	5,674,530.00	4.39
17	601601	中国太保	5,450,093.64	4.22
18	000002	万科 A	5,269,760.02	4.08
19	601336	新华保险	4,768,511.50	3.69
20	600196	复星医药	4,670,517.00	3.62
21	000651	格力电器	4,626,563.00	3.58
22	002142	宁波银行	4,501,887.16	3.49
23	600048	保利地产	4,497,168.00	3.48
24	600383	金地集团	4,289,466.00	3.32
25	600009	上海机场	4,169,485.07	3.23
26	601818	光大银行	3,394,410.00	2.63
27	600104	上汽集团	3,338,342.48	2.58

28	601933	永辉超市	3,271,909.00	2.53
29	000858	五粮液	3,228,183.00	2.50
30	000895	双汇发展	3,178,263.00	2.46
31	002025	航天电器	2,873,697.00	2.22
32	000001	平安银行	2,825,744.00	2.19
33	601888	中国国旅	2,735,300.30	2.12
34	600760	中航沈飞	2,670,757.00	2.07
35	601628	中国人寿	2,629,960.00	2.04

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600027	华电国际	14,060,196.72	10.88
2	600377	宁沪高速	11,393,782.31	8.82
3	601288	农业银行	9,887,933.00	7.65
4	600036	招商银行	8,094,977.00	6.27
5	601328	交通银行	8,025,094.00	6.21
6	601988	中国银行	8,004,649.00	6.20
7	600900	长江电力	7,668,218.00	5.94
8	600011	华能国际	7,195,491.00	5.57
9	601939	建设银行	6,753,012.00	5.23
10	601688	华泰证券	6,287,033.00	4.87
11	601398	工商银行	6,031,626.00	4.67
12	600030	中信证券	5,989,706.00	4.64
13	601336	新华保险	4,780,301.00	3.70
14	002142	宁波银行	4,674,442.06	3.62
15	600583	海油工程	4,512,013.00	3.49
16	601166	兴业银行	4,353,267.00	3.37
17	000895	双汇发展	3,593,666.00	2.78
18	601933	永辉超市	3,234,024.00	2.50
19	000001	平安银行	3,209,222.00	2.48
20	600887	伊利股份	3,098,843.82	2.40
21	000651	格力电器	2,875,301.70	2.23
22	000002	万科 A	2,848,731.00	2.21
23	002025	航天电器	2,767,741.60	2.14
24	603259	药明康德	2,750,460.00	2.13

25	601628	中国人寿	2,726,506.00	2.11
26	600009	上海机场	2,672,710.56	2.07

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。

8.4.3 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	340,202,430.53
卖出股票收入（成交）总额	258,511,040.38

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。

8.5 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	29,269,570.00	22.66
2	央行票据	—	—
3	金融债券	26,668,424.00	20.65
	其中：政策性金融债	26,668,424.00	20.65
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	55,937,994.00	43.31

8.6 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	195,250	19,671,437.50	15.23
2	010107	21 国债(7)	187,480	19,263,570.00	14.91
3	019611	19 国债 01	100,000	10,006,000.00	7.75
4	018006	国开 1702	68,230	6,996,986.50	5.42

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.1 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	184,088.71
2	应收证券清算款	1,690,530.68
3	应收股利	-
4	应收利息	1,045,147.56
5	应收申购款	13,683.57

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,933,450.52

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 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	2,415,645.76	45.26
	其中：股票	2,415,645.76	45.26
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	149,970.00	2.81
	其中：债券	149,970.00	2.81
	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	2,763,269.74	51.77
8	其他资产	8,250.99	0.15
9	合计	5,337,136.49	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,134,893.04	40.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,964.06	1.02
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	226,788.66	4.31
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	—	—

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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,415,645.76	45.87

8.2.2 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进行积极投资。

8.2.3 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通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

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	601012	隆基股份	5,655	163,768.80	3.11
2	002202	金风科技	10,574	155,966.50	2.96
3	600522	中天科技	14,398	148,299.40	2.82
4	600089	特变电工	17,155	138,783.95	2.64
5	300274	阳光电源	10,700	138,244.00	2.63
6	002074	国轩高科	7,198	124,453.42	2.36
7	002594	比亚迪	2,242	123,444.52	2.34
8	300001	特锐德	5,400	120,528.00	2.29
9	600406	国电南瑞	5,761	115,738.49	2.20
10	300014	亿纬锂能	4,500	90,855.00	1.73
11	300207	欣旺达	7,456	88,651.84	1.68
12	600525	长园集团	12,440	83,223.60	1.58
13	600312	平高电气	7,618	72,371.00	1.37
14	000400	许继电气	6,356	71,695.68	1.36
15	300068	南都电源	4,446	69,179.76	1.31
16	601222	林洋能源	9,900	58,905.00	1.12
17	002028	思源电气	4,813	56,985.92	1.08
18	002063	远光软件	6,460	52,972.00	1.01

19	600995	文山电力	6,600	50,424.00	0.96
20	002339	积成电子	5,797	47,535.40	0.90
21	002364	中恒电气	3,349	36,772.02	0.70
22	002665	首航节能	11,880	36,471.60	0.69
23	002256	兆新股份	10,500	36,330.00	0.69
24	300183	东软载波	2,526	36,096.54	0.69
25	600517	置信电气	8,400	35,280.00	0.67
26	600590	泰豪科技	4,978	31,958.76	0.61
27	600405	动力源	5,553	29,986.20	0.57
28	002121	科陆电子	5,425	29,891.75	0.57
29	300477	合纵科技	2,900	28,043.00	0.53
30	002218	拓日新能	7,400	26,714.00	0.51
31	002516	旷达科技	7,079	23,148.33	0.44
32	002335	科华恒盛	1,313	22,885.59	0.43
33	002322	理工环科	1,947	21,981.63	0.42
34	002580	圣阳股份	2,700	16,173.00	0.31
35	300427	红相股份	1,300	16,107.00	0.31
36	300198	纳川股份	3,600	12,240.00	0.23
37	300332	天壕环境	831	3,540.06	0.07

8.3.2 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600995	文山电力	56,046.00	1.13
2	002339	积成电子	52,640.00	1.06
3	600089	特变电工	49,056.00	0.99
4	300001	特锐德	47,628.00	0.96
5	002594	比亚迪	45,624.00	0.92
6	002074	国轩高科	43,688.00	0.88
7	600522	中天科技	40,600.00	0.82
8	300274	阳光电源	39,720.00	0.80
9	002202	金风科技	35,820.00	0.72

10	300014	亿纬锂能	28,596.00	0.58
11	000400	许继电气	21,344.00	0.43
12	002028	思源电气	20,817.00	0.42
13	002276	万马股份	19,799.00	0.40
14	300068	南都电源	16,984.00	0.34
15	600406	国电南瑞	10,968.00	0.22
16	300183	东软载波	10,638.00	0.21
17	300207	欣旺达	7,620.00	0.15
18	002364	中恒电气	7,086.00	0.14
19	600703	三安光电	6,782.00	0.14
20	300477	合纵科技	5,430.00	0.11

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。

8.4.2 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	002202	金风科技	178,877.00	3.61
2	600703	三安光电	170,704.95	3.45
3	601012	隆基股份	164,237.00	3.32
4	600089	特变电工	159,660.00	3.22
5	300274	阳光电源	157,098.00	3.17
6	600522	中天科技	149,038.00	3.01
7	600406	国电南瑞	144,528.00	2.92
8	002594	比亚迪	126,558.00	2.55
9	300001	特锐德	123,094.00	2.48
10	002074	国轩高科	114,387.00	2.31
11	002276	万马股份	102,911.60	2.08
12	300014	亿纬锂能	101,480.00	2.05
13	300207	欣旺达	94,564.00	1.91
14	000400	许继电气	82,402.00	1.66
15	600312	平高电气	82,326.00	1.66
16	300068	南都电源	79,241.00	1.60
17	600525	长园集团	69,118.00	1.40
18	601222	林洋能源	64,459.00	1.30
19	002028	思源电气	63,117.00	1.27
20	002339	积成电子	62,378.00	1.26

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。

8.4.3 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	591,252.00
卖出股票收入（成交）总额	2,870,590.05

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。

8.5 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	149,970.00	2.85
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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	149,970.00	2.85

8.6 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	1,500	149,970.00	2.85

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 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	3,228.56
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,022.43
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	8,250.99

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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的情况。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
339	437,724.53	139,712,661.93	94.15%	8,675,954.05	5.85%

9.2 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	1,410,330.72	0.95%

9.3 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
528	14,439.77	3,846,649.73	50.45%	3,777,549.07	49.55%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王磊	206,417.00	9.36%
2	张煜能	122,538.00	5.56%
3	刘瑜	107,772.00	4.89%
4	王文礼	91,319.00	4.14%
5	林元者	90,200.00	4.09%
6	胡永智	70,700.00	3.21%
7	马晓梅	66,800.00	3.03%
8	李振琴	63,700.00	2.89%
9	周文斌	63,400.00	2.87%
10	夏贞依	60,500.00	2.74%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	109.09	0.00%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	7,624,198.80
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	225,120,670.13
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	84,356,252.95
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）	-
本报告期期末基金份额总额	148,388,615.98

注：转型后的本基金基金合同于 2019 年 2 月 26 日起正式生效，本报告期为 2019 年 2 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	242,530,801.91
本报告期期初基金份额总额	8,066,040.49
本报告期基金总申购份额	628,910.26
减:本报告期基金总赎回份额	1,070,751.95
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	7,624,198.80

注：上表中“报告期期末”为2019年2月25日。本报告期为2019年1月1日至2019年2月25日。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人自 2019 年 1 月 2 日 0:00 起至 2019 年 1 月 18 日 17:00 止，以通讯方式召开长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）的基金份额持有人大会，审议《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计 4,169,164.25 份，占权益登记日该基金总份额的 51.69%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的 100%，本次会议议案于 2019 年 1 月 21 日获得通过，基金管理人已于 2019 年 1 月 22 日在指定报刊及指定网站上就决议生效事项进行了公告。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 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无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

自 2019 年 2 月 26 日起，《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》正式生效，其投资策略变更为：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、港股通投资策略、其他类型资产投资策略。

本基金详细的投资策略可参见《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》等法律文件。

11.5 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会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 30,000.00 元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 3 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 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	
国泰君安	2	313,560,827.70	53.62%	255,164.47	56.26%	-
申港证券	1	271,262,646.05	46.38%	198,372.80	43.74%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

11.7.2 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
国泰君安	41,156,897.60	21.40%	3,822,200,000.00	86.63%	-	-
申港证券	151,121,183.10	78.60%	590,000,000.00	13.37%	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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	
国泰君安	2	2,111,695.10	61.00%	1,755.38	64.00%	-
申港证券	1	1,350,146.95	39.00%	987.27	36.00%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

11.7.2 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申港证券	149,895.00	100.00%	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	长信价值优选混合型证券投资基金基金合同及摘要（仅摘要见报）	上证报、公司网站	2019 年 1 月 22 日
2	长信价值优选混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2019 年 1 月 22 日
3	长信价值优选混合型证券投资基金招募说明书	上证报、公司网站	2019 年 1 月 22 日
4	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信价值优选混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、公司网站	2019 年 2 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 1 日
6	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 2 日
7	长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务并参与部分销售机构申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 14 日
8	长信基金管理有限责任公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下长信价值优选混合型证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 20 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、公司网站	2019 年 3 月 28 日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 4 月 8 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 4 月 15 日
12	长信价值优选混合型证券投资基金（原长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF））2019 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2019 年 4 月 22 日
13	长信基金管理有限责任公司关于增加华鑫证券有限责任公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 4 月 26 日
14	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信价值优选混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、公司网站	2019 年 4 月 30 日
15	长信基金管理有限责任公司关于长信价值	上证报、公司网站	2019 年 5 月 6 日

	优选混合型证券投资基金基金经理变更的公告		
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 5 月 7 日
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 5 月 22 日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	上证报、公司网站	2019 年 6 月 13 日
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 6 月 22 日
20	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、公司网站	2019 年 6 月 26 日
21	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银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019 年 6 月 27 日
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2019 年 6 月 30 日资产净值的公告	公司网站	2019 年 7 月 1 日
23	长信价值优选混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	上证报、公司网站	2019 年 7 月 18 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(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	2019 年 7 月 30 日
25	长信价值优选混合型证券投资基金证券投资基金(原长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金转型)2019 年半年度报告及摘要(仅摘要见报)	上证报、公司网站	2019 年 8 月 27 日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 9 月 25 日
27	长信价值优选混合型证券投资基金更新的招募说明书(2019 年第【1】号)及摘要(仅摘要见报)	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 10 月 9 日
28	长信价值优选混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 10 月 23 日
29	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 10 月 23 日

30	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、中国证监会 信息披露网站、公司 网站	2019 年 12 月 30 日
31	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金相关法律文件的公告	上证报、中证报、证 券时报、证券日报、 中国证监会信息披露 网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
32	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及摘要的提示性公告	上证报、中证报、证 券时报、证券日报、 中国证监会信息披露 网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
33	长信价值优选混合型证券投资基金更新的招募说明书及摘要（仅摘要见报）	上证报、中国证监会 信息披露网站、公司 网站	2019 年 12 月 31 日
34	长信价值优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会信息披露 网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
35	长信价值优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会信息披露 网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日

11.9 其他重大事件（转型前）

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基金 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2019 年 1 月 1 日
2	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）费及转换业务的申购补差费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2019 年 1 月 10 日
3	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）、赎回、转托管业务的公告	中证报、证券时报、 公司网站	2019 年 1 月 17 日
4	长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）2018 年第 4 季度报告	上证报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
5	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）停复牌提示性公告	上证报、公司网站	2019 年 1 月 21 日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）恢复赎回业务的公告	上证报、公司网站	2019 年 1 月 22 日
7	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）	上证报、公司网站	2019 年 1 月 22 日

	基金份额持有人大会决议生效公告		
8	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)暂停场内交易的提示性公告	上证报、公司网站	2019 年 2 月 21 日
9	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)终止上市公告	上证报、公司网站	2019 年 2 月 26 日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金份额“确权”登记指引	上证报、公司网站	2019 年 2 月 26 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 1 日
12	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 2 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、公司网站	2019 年 3 月 28 日
14	长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）2018 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、公司网站	2019 年 3 月 29 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 4 月 24 日； 2019 年 5 月 9 日至 2019 年 5 月 28 日； 2019 年 11 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日	3,846,449.73	40,230,178.74	0.00	44,076,628.47	29.70%
	2	2019 年 4 月 25 日至 2019 年 5 月 26 日	0.00	13,780,319.74	0.00	13,780,319.74	9.29%
	3	2019 年 4 月 25 日至 2019 年 5 月	0.00	27,716,208.24	0.00	27,716,208.24	18.68%

		26 日					
	4	2019 年 5 月 27 日至 2019 年 5 月 28 日	0.00	23,819,775.48	23,819,775.48	0.00	0.00%
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。 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。							

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长信价值优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《长信价值优选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。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 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

2020 年 4 月 27 日