

长信利保债券型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信利保债券
场内简称	长信利保
基金主代码	519947
交易代码	519947
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 16 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,512,173.98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,317,609.96
本期利润	-1,024,864.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0167
本期基金份额净值增长率	-1.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2064
期末基金资产净值	44,437,878.77
期末基金份额净值	0.9160

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

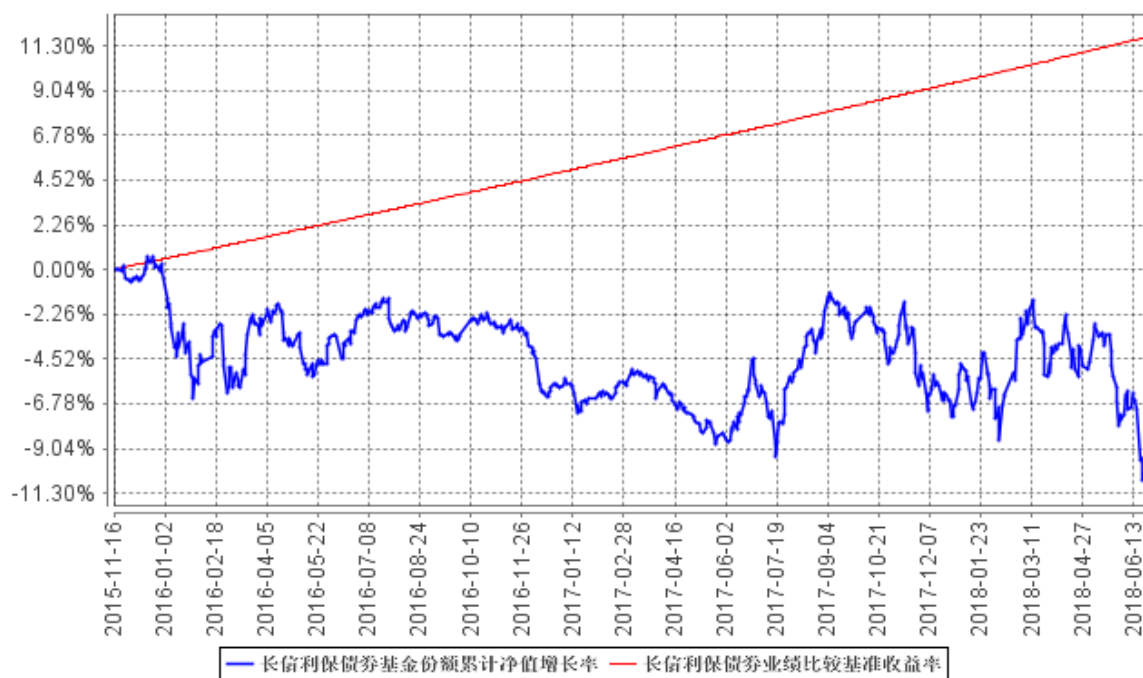
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.14%	1.04%	0.35%	0.01%	-1.49%	1.03%
过去三个月	-4.42%	0.80%	1.07%	0.01%	-5.49%	0.79%
过去六个月	-1.65%	0.78%	2.13%	0.01%	-3.78%	0.77%
过去一年	-2.77%	0.66%	4.34%	0.01%	-7.11%	0.65%
自基金合同生效起至今	-8.40%	0.51%	11.80%	0.01%	-20.20%	0.50%

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



注：1、图示日期为 2015-11-16 至 2018-06-30。

2、按基金合同规定，本基金管理人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约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信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、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员	2015 年 11 月 16 日	—	20 年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd. 2002 年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
王夏儒	长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 5 月 29 日	-	8 年	上海财经大学管理学硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券股份有限公司、华富基金管理有限公司、华创证券有限责任公司。2017 年加入长信基金管理有限公司，曾任职于固收专户投资部，现任职于混合债券部并担任长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
刘婧	曾任本基金的基金经理助理	2016 年 12 月 12 日	2018 年 2 月 2 日	5 年	曾任本基金的基金经理助理

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

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

3、报告截止日至报告批准送出日期间，自 2018 年 7 月 10 日起，李小羽先生不再担任本基金的基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年以来，国内外的宏观环境不确定性加剧，无论是权益还是固定收益市场，走势均呈现震荡分化。权益市场经历了年初的大幅波动后，先后出现了创业板、消费、医药和石化等板块的轮动上涨，各行业优质个股获得超额收益。债券市场，在流动性和货币逐步宽松的推动下，以利率债为代表的无风险收益大幅下行，并逐步扩散至部分高等级信用品种。

上半年以科技创新为代表的成长板块，在一系列政策利好催化下，连续快速上涨，我们踏准了上涨节奏，深入研究个股，选取细分行业龙头，通过价差交易，获得超额收益。随后，在判断整体震荡行情的前提下，对收益及时兑现，并且在避险板块进行等待。债券类资产，在国债利率出现见顶迹象之后，迅速介入利率债的交易行情，获得波段操作收益。并且判断趋势确立后，适当拉长久期和配置仓位。信用债方面，继续控制信用风险，优选高等级流动性好的品种，保证组合的稳健盈利。此外，本基金适当配置了部分低估值转债品种，以期在正股上涨和流动性拐点到来时，获得业绩和估值提升的双重收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9160 元，报告期基金份额净值增长率为-1.65%，成立以来的累计净值为 0.9160 元，本期业绩比较基准增长率为 2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然今年宏观环境较为复杂，但是我们仍然看到国内经济的韧性和潜力。在近期一系列政策发布的信号作用下，表明对整体经济走势做好了提前的应对，无论是传统基建还是新兴的科技领域，都会继续拉动经济的平稳向好发展。目前，市场估值已经接近历史底部，监管政策也较此前有所缓和，市场有望企稳回升。经过上半年市场的震荡整理，前期一些高估值的个股已经回到合理估值，今年将获取真正业绩所带来的价值回报。关注半年报发布窗口，挖掘业绩超预期，在下跌中被错杀的品种，继续看好科技、医药、金融等板块的中长期机会。

在市场趋势弱化，波动加大情况下，需要我们加强研判，甄别个股，加强做好仓位和回撤控制。我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断，积极寻找权益资产的增强机会。密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，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及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员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。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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金收益分配原则如下：

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,320,848.61	1,843,537.43
结算备付金	706,926.51	1,096,615.06
存出保证金	65,600.10	44,607.63
交易性金融资产	49,281,730.96	70,958,151.27
其中：股票投资	8,830,470.00	11,955,594.00
基金投资	-	-
债券投资	40,451,260.96	59,002,557.27
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	980,353.41	1,862,417.14
应收利息	184,492.78	837,660.90
应收股利	-	-
应收申购款	109.91	129.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	52,540,062.28	76,643,119.33
负债和所有者权益	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	15,000,000.00
应付证券清算款	1,640,479.83	1,173,632.43
应付赎回款	151,185.07	1,092.52
应付管理人报酬	30,292.79	36,911.12
应付托管费	8,655.07	10,546.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	128,197.44	239,494.86

应交税费	65,962.22	65,560.00
应付利息	-1,356.27	14,757.50
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	78,767.36	289,002.47
负债合计	8,102,183.51	16,830,996.94
所有者权益：		
实收基金	48,512,173.98	64,216,398.41
未分配利润	-4,074,295.21	-4,404,276.02
所有者权益合计	44,437,878.77	59,812,122.39
负债和所有者权益总计	52,540,062.28	76,643,119.33

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9160 元，基金份额总额 48,512,173.98 份。

6.2 利润表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	165,480.57	2,342,521.44
1.利息收入	482,259.23	4,169,538.63
其中：存款利息收入	19,211.63	73,167.48
债券利息收入	463,047.60	4,082,942.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	13,428.64
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,621,670.96	-28,716,869.09
其中：股票投资收益	-638,531.36	-18,961,386.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,014,691.60	-9,886,098.42
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	31,552.00	130,616.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,292,745.60	26,810,682.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	12,146.70	79,169.21
减：二、费用	1,190,344.93	2,610,782.82

1. 管理人报酬	202,460.90	931,083.98
2. 托管费	57,845.97	266,024.05
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	596,833.83	386,543.96
5. 利息支出	242,229.59	838,128.11
其中：卖出回购金融资产支出	242,229.59	838,128.11
6. 税金及附加	168.51	-
7. 其他费用	90,806.13	189,002.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,024,864.36	-268,261.38
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,024,864.36	-268,261.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	64,216,398.41	-4,404,276.02	59,812,122.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,024,864.36	-1,024,864.36
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）	-15,704,224.43	1,354,845.17	-14,349,379.26
其中：1.基金申购款	12,374,034.72	-392,593.27	11,981,441.45
2.基金赎回款	-28,078,259.15	1,747,438.44	-26,330,820.71
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）	48,512,173.98	-4,074,295.21	44,437,878.77

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	663,227,870.04	-39,237,344.11	623,990,525.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-268,261.38	-268,261.38
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)	-578,355,835.73	34,594,698.19	-543,761,137.54
其中：1.基金申购款	215,677.67	-13,241.87	202,435.80
2.基金赎回款	-578,571,513.40	34,607,940.06	-543,963,573.34
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)	84,872,034.31	-4,910,907.30	79,961,127.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 成善栋	_____ 覃波	_____ 孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利保债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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》、《长信利保债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]2211 号文批准公开募集。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 305,129,173.65 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 1500956 号验资报告。基金合同于 2015 年 11 月 16 日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信利保债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、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)、货币市场工具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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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、债券免征营业税和增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.6 关联方关系

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

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	202,460.90	931,083.98
其中：支付销售机构的客户维护费	82,131.41	147,451.94

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率逐日计提，按月支付。

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

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,845.97	266,024.05

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率逐日计提，按月支付。

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

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,320,848.61	11,701.78	3,305,647.13	70,973.74

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 706,926.51 元。（2017 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,096,615.06 元）

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。本基金非基金中基金，不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.8 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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 6,000,000.00 元，于 2018 年 7 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 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,830,470.00	16.81
	其中：股票	8,830,470.00	16.81
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	40,451,260.96	76.99
	其中：债券	40,451,260.96	76.99
	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	2,027,775.12	3.86
8	其他各项资产	1,230,556.20	2.34
9	合计	52,540,062.28	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	6,408,370.00	14.42
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	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,778,900.00	4.00
J	金融业	643,200.00	1.45
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	8,830,470.00	19.87

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603019	中科曙光	51,000	2,339,370.00	5.26
2	300474	景嘉微	37,000	1,719,760.00	3.87
3	603986	兆易创新	14,000	1,519,280.00	3.42
4	300496	中科创达	35,000	1,031,450.00	2.32
5	300377	赢时胜	55,000	747,450.00	1.68
6	601336	新华保险	15,000	643,200.00	1.45
7	000977	浪潮信息	20,000	477,000.00	1.07
8	002049	紫光国微	8,000	352,960.00	0.79

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	15,076,243.68	25.21
2	002236	大华股份	10,354,015.00	17.31
3	000977	浪潮信息	7,802,565.71	13.05
4	601111	中国国航	7,404,436.00	12.38
5	601336	新华保险	6,890,433.00	11.52
6	603019	中科曙光	6,809,148.43	11.38

7	601601	中国太保	6,612,194.00	11.05
8	600340	华夏幸福	5,634,018.78	9.42
9	300474	景嘉微	4,681,577.00	7.83
10	600048	保利地产	4,514,549.00	7.55
11	000063	中兴通讯	3,954,583.18	6.61
12	600030	中信证券	3,501,083.00	5.85
13	002146	荣盛发展	3,290,829.00	5.50
14	601318	中国平安	3,289,447.46	5.50
15	603986	兆易创新	3,255,977.20	5.44
16	000034	神州数码	3,114,939.00	5.21
17	002458	益生股份	3,016,815.00	5.04
18	600703	三安光电	3,002,898.22	5.02
19	600567	山鹰纸业	2,936,560.00	4.91
20	001979	招商蛇口	2,931,755.00	4.90
21	600029	南方航空	2,905,585.00	4.86
22	002415	海康威视	2,812,975.00	4.70
23	300065	海兰信	2,791,836.16	4.67
24	000001	平安银行	2,783,636.00	4.65
25	600584	长电科技	2,762,950.00	4.62
26	002439	启明星辰	2,667,384.00	4.46
27	601398	工商银行	2,579,200.00	4.31
28	603877	太平鸟	2,406,610.36	4.02
29	002281	光迅科技	2,369,249.00	3.96
30	002025	航天电器	2,366,963.97	3.96
31	002234	民和股份	2,203,682.00	3.68
32	300136	信维通信	2,148,226.73	3.59
33	300302	同有科技	2,117,672.00	3.54
34	000858	五粮液	1,923,685.00	3.22
35	603228	景旺电子	1,832,112.00	3.06
36	600887	伊利股份	1,793,275.00	3.00
37	601088	中国神华	1,776,819.00	2.97
38	600011	华能国际	1,748,905.17	2.92
39	002463	沪电股份	1,715,503.50	2.87
40	600562	国睿科技	1,713,370.00	2.86
41	600060	海信电器	1,712,555.00	2.86
42	300365	恒华科技	1,673,465.25	2.80

43	300164	通源石油	1,671,454.00	2.79
44	002174	游族网络	1,628,184.00	2.72
45	601155	新城控股	1,592,482.98	2.66
46	600859	王府井	1,570,966.10	2.63
47	300373	扬杰科技	1,526,774.00	2.55
48	600171	上海贝岭	1,511,691.00	2.53
49	300016	北陆药业	1,452,514.00	2.43
50	300223	北京君正	1,421,955.00	2.38
51	002299	圣农发展	1,396,908.00	2.34
52	600195	中牧股份	1,222,010.00	2.04
53	300604	长川科技	1,209,460.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	15,126,940.83	25.29
2	002236	大华股份	10,433,538.30	17.44
3	000977	浪潮信息	7,624,828.90	12.75
4	601111	中国国航	7,446,244.30	12.45
5	603019	中科曙光	6,624,790.56	11.08
6	601601	中国太保	6,621,698.00	11.07
7	601336	新华保险	6,522,862.16	10.91
8	600340	华夏幸福	5,573,242.13	9.32
9	300474	景 嘉 微	4,773,056.70	7.98
10	600048	保利地产	4,552,561.92	7.61
11	600030	中信证券	3,515,620.00	5.88
12	002146	荣盛发展	3,334,666.00	5.58
13	601318	中国平安	3,310,680.00	5.54
14	002025	航天电器	3,216,965.00	5.38
15	000063	中兴通讯	3,193,041.00	5.34
16	603986	兆易创新	2,979,446.00	4.98
17	600703	三安光电	2,972,394.00	4.97
18	002458	益生股份	2,931,839.00	4.90
19	600567	山鹰纸业	2,906,068.00	4.86
20	001979	招商蛇口	2,874,025.00	4.81

21	300065	海 兰 信	2,872,786.00	4.80
22	600029	南方航空	2,861,224.00	4.78
23	000034	神州数码	2,831,890.34	4.73
24	002415	海康威视	2,794,693.41	4.67
25	600584	长电科技	2,727,960.00	4.56
26	000001	平安银行	2,720,254.00	4.55
27	002439	启明星辰	2,661,641.62	4.45
28	002281	光迅科技	2,518,598.00	4.21
29	601398	工商银行	2,472,400.00	4.13
30	600171	上海贝岭	2,452,343.00	4.10
31	603877	太平鸟	2,409,609.40	4.03
32	002234	民和股份	2,261,724.00	3.78
33	300136	信维通信	2,212,844.28	3.70
34	300033	同 花 顺	2,168,833.00	3.63
35	300302	同有科技	2,063,712.00	3.45
36	000858	五 粮 液	1,946,020.00	3.25
37	002174	游族网络	1,749,836.90	2.93
38	603228	景旺电子	1,744,736.00	2.92
39	300365	恒华科技	1,719,300.00	2.87
40	600011	华能国际	1,718,208.40	2.87
41	600887	伊利股份	1,713,000.00	2.86
42	600562	国睿科技	1,712,372.00	2.86
43	601088	中国神华	1,703,083.00	2.85
44	600060	海信电器	1,666,196.00	2.79
45	601155	新城控股	1,636,067.00	2.74
46	002463	沪电股份	1,621,594.20	2.71
47	300164	通源石油	1,599,483.00	2.67
48	300373	扬杰科技	1,572,214.00	2.63
49	600859	王府井	1,515,434.19	2.53
50	300223	北京君正	1,476,899.00	2.47
51	300016	北陆药业	1,440,776.12	2.41
52	002299	圣农发展	1,412,888.00	2.36
53	600570	恒生电子	1,408,059.00	2.35
54	300604	长川科技	1,241,645.00	2.08
55	600188	兖州煤业	1,241,603.00	2.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	238,214,440.08
卖出股票收入（成交）总额	240,861,027.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,560,100.00	12.51
	其中：政策性金融债	5,560,100.00	12.51
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）	34,891,160.96	78.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,451,260.96	91.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	40,000	4,059,200.00	9.13
2	128024	宁行转债	38,000	3,975,180.00	8.95
3	123003	蓝思转债	39,988	3,697,690.36	8.32
4	018002	国开 1302	35,000	3,552,500.00	7.99
5	128035	大族转债	29,992	3,443,081.60	7.75

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	65,600.10
2	应收证券清算款	980,353.41
3	应收股利	—
4	应收利息	184,492.78
5	应收申购款	109.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,230,556.20

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	4,059,200.00	9.13
2	128024	宁行转债	3,975,180.00	8.95
3	123003	蓝思转债	3,697,690.36	8.32
4	110032	三一转债	3,069,727.40	6.91
5	123006	东财转债	3,006,750.00	6.77
6	110042	航电转债	2,418,450.00	5.44
7	113013	国君转债	1,606,776.60	3.62
8	128015	久其转债	1,123,200.00	2.53
9	110031	航信转债	818,720.00	1.84

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
636	76,277.00	1,997,267.98	4.12%	46,514,906.00	95.88%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 11 月 16 日 ）基金份额总额	305, 129, 173. 65
本报告期期初基金份额总额	64, 216, 398. 41
本报告期基金总申购份额	12, 374, 034. 72
减：本报告期基金总赎回份额	28, 078, 259. 15
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	48, 512, 173. 98

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	211,822,890.91	44.21%	112,541.50	36.33%	—
新时代证券	1	107,863,884.55	22.52%	78,881.54	25.46%	—
江海证券	1	84,199,692.91	17.58%	78,415.52	25.31%	—
招商证券	1	75,188,999.13	15.69%	39,947.81	12.90%	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

光大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	157,719,032.14	64.09%	341,800,000.00	100.00%	-	-
新时代证券	33,773,065.45	13.72%	-	-	-	-
江海证券	19,665,944.07	7.99%	-	-	-	-
招商证券	34,917,764.52	14.19%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用新时代证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29 号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48 号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

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

进行选择基金专用交易单元。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2018 年 8 月 29 日