

(上接B190版)

法定代表人:潘东	联系人:潘东
电话:021-52922963	传真:021-52927270
客户服务热线:400-046-4788	网址:www.fundchina.com

(72) 上海晨基基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号1608单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号56楼

法定代表人:毛林	联系人:毛林
电话:021-30123697	传真:021-30123413
客户服务热线:400-801016	网址:www.fundshijie.com

(73) 上海金石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区福山路960-9602-115室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1910号大都会

法定代表人:徐武斌	联系人:曹佳慧
电话:021-60906200	传真:021-63326263
客户服务热线:4006453389	网址:www.vestonwealth.com

(74) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川路647号1002室
办公地址:上海浦东新区瑞山东路91号10楼1228

法定代表人:李莉春	联系人:徐静
电话:06-021-50669033	传真:06-021-50669033
客户服务热线:400-021-7755	网址:http://www.lidder.com.cn/

(75) 上海惠利基金销售有限公司
注册地址:上海市静安区南京西路1466号1902室-3401
办公地址:广州市天河区珠江大道1号保利国际广场1201-1203

法定代表人:尹博	联系人:尹博
电话:020-89620032	传真:020-89629011
客户服务热线:400-81962006	网址:www.yinbo.com

(76) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号2层216室A座11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号2层216室A座11层1108号

法定代表人:王树刚	联系人:丁雨薇
电话:010-46282140	传真:010-46280227
客户服务热线:400-4196-0169	网址:www.hc360.com

(77) 上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号2幢2楼2608室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人:李一博	联系人:仲秋明
电话:010-88066632	传真:010-88066632
客户服务热线:4008176666	网址:www.amfchina.com

(78) 和信保险销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区三里中街6号中融信大厦2002
办公地址:北京市朝阳区福寿里19号大成号财富金融中心C

法定代表人:薛洪	联系人:张潮
电话:010-38262134	传真:010-38262134
客户服务热线:4008116669	网址:www.hx-bx.com

(79) 一创财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路11号2层216室A座11层1108号
办公地址:北京市朝阳区东三环北路11号2层216室A座11层1108号

法定代表人:梁洪涛	联系人:徐静
电话:010-4801277-8032	传真:010-48013209
客户服务热线:400-001-1566	网址:www.yicreat.com

(80) 嘉实基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道16号9层嘉实中心办公楼层
办公地址:北京市朝阳区国际颐园9号金地中心A座602

法定代表人:魏星	联系人:王吉
电话:021-38786623	传真:021-38788023
客户服务热线:400-600-8800	网址:www.jiashifund.com

(81) 北京嘉实基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元2102207
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元2102207

法定代表人:钟爱华	联系人:钟爱华
电话:010-61940688	传真:010-61940689
客户服务热线:4000-619-618	网址:www.zhongaiapp.com

(82) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号三楼B12(上海嘉善经济开发区)
办公地址:上海市浦东新区南汇新城499号太平金融大厦1002室

法定代表人:王翔	联系人:吴海娟
电话:021-4637077-255	传真:021-55085991
客户服务热线:400-500-8389	网址:www.jiyufund.com.cn

(83) 开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门1010室
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门1010室

法定代表人:李刚	联系人:曹伟涛
电话:029-88447111	传真:029-88447611
客户服务热线:029-88224030-8899	网址:www.kysec.cn

3.场外申购赎回
场外申购赎回是指有基金投资资格的上海证券交易所会员,名单详见上海证券交易所网站:<http://www.sse.com.cn>

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 其他相关机构

信息类别	登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限公司	上海锦泰律师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址	北京市西城区太平桥大街19号	北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦1002室	北京市西城区金融大街19号富都大厦B座1602室
办公地址	北京市西城区太平桥大街19号	北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦1002室	北京市西城区金融大街19号富都大厦B座1602室
法定代表人:王瑞	联系人:董晓燕		
电话:021-4637077-255	传真:021-55085991		
客户服务热线:400-500-8389	网址:www.jiyufund.com.cn		

四、基金的名称
长信永利精选混合型证券投资基金

五、基金的类型
契约开放式

六、基金的投资目标
本基金主要投资于大盘价值股,并在保持基金资产安全性和流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向
本基金管理人建立大盘价值型上市公司综合评价指标体系的基础上,通过深入调研基础上的定量分析和定性分析相结合的方式,精选大盘价值股进行投资。

(一) 大盘价值股的主要特征
本基金投资的大盘价值股,是指业务规模较大、经营管理稳健、业绩优良且市场价格被相对低估的股票。主要有以下特征:

1、公司规模较大、经营状况良好,具备一定的规模优势和较高的抗风险能力;

2、公司有稳定的业绩,有现金分红历史记录或预期有持续现金分红能力;

3、公司的市场占有率较高,有良好的市场知名度和品牌效应;

4、公司具备某些领域的独特优势,如专利、专有技术、特许经营、优质的土地、健全的销售网络等,其实际价值未被市场认识或被市场低估。

(二) 大盘价值股的量化标准
本基金选择的大盘价值股必须同时满足以下条件:

1、按股票流通市值由大至小排列,累计流通市值占市场总流通市值比例前60%的全部股票;

2、净资产或市盈率低于大盘股的平均水平。

在上述筛选结果的基础上,本基金通过对公司基本面和市场的系统分析选择适合的个股进行投资。

八、基金的投资策略
(一) 复合型投资策略
“由上至下”的资产配置流程与“由下至上”的选股流程相结合的投资策略。其中,“由上至下”的资产配置流程表现为:从宏观层面出发,在可控风险前提下优化资产的配置比例;“由下至上”的选股流程表现为:从微观层面出发,通过对投资对象深入系统的分析来挖掘上市公司内在价值,积极寻求价值被低估的证券进行投资。

(二) 适度分散投资策略
在确保基金资产的安全性和流动性的前提下,在对宏观经济、行业、公司和证券市场等因素深入分析的基础上,适度分散投资于个股,谋求基金资产的长期稳定增值。

(三) 动态调整策略
体现为投资组合中个股的动态调整策略和股票仓位对动态调整策略两方面。投资组合中个股的动态调整策略是指:基于对各种影响因素变化的深入分析,定期或临时调整投资组合中的个股投资比例。股票仓位的动态调整策略是指:基于对股票市场趋势研判,动态调整股票仓位。

九、基金的业绩比较基准
2015年8月7日起本基金业绩比较基准由“中信标普100指数×80%+中债国债指数×20%”变更为“中信标普100指数×80%+中证综合债指数×20%”。关于变更业绩比较基准的事宜,我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年3月31日,本报告中所有财务数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,079,087,798.25	76.46
2	基金投资	1,079,087,798.25	76.46
3	固定收益投资	270,734,309.60	19.20
4	其中:债券	270,734,309.60	19.20
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	44,831,260.73	3.18
11	其他资产	16,485,747.28	1.17
12	合计	1,410,139,105.76	100.00

注:本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1. 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	25,520,000.00	1.88
C	制造业	485,429,759.91	34.94
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	81,190,000.00	5.83
F	批发和零售业	127,328,476.29	9.17
G	交通运输、仓储和邮政业	30,071,669.62	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	109,110,468.68	7.84
J	金融业	110,956,302.75	7.96
K	房地产业	92,265,100.00	6.62
L	科学研究和技术服务业	19,328,000.00	1.39
M	医药、保健和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	其他服务业、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,079,087,798.25	77.27

2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

(三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002310	东方明珠	3,300,000	68,276,000.00	4.91
2	603294	苏宁环球	4,000,000	56,280,000.00	4.04
3	601208	工商银行	8,000,000	46,720,000.00	3.35
4	601939	建设银行	6,000,417	38,263,231.76	2.73
5	600048	保利地产	2,900,000	37,776,000.00	2.71
6	300383	光环新网	2,000,000	37,500,000.00	2.68
7	010177	正海磁材	1,400,000	36,862,000.00	2.65
8	602640	跨境通	1,800,000	35,370,000.00	2.54
9	000063	中兴通讯	1,150,077	34,674,821.55	2.49
10	003808	歌力思	1,600,080	32,849,642.40	2.36

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	89,544,000.00	6.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,470,000.00	5.13
4	其中:政策性金融债	71,470,000.00	5.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	109,720,300.40	7.87
8	债券回购	-	-
9	其他	-	-
10	合计	270,734,309.60	19.43

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019102	国开1302	700,000	71,470,000.00	5.13
2	019107	光大转债	500,000	50,560,000.00	3.63
3	113011	光大转债	400,000	43,382,000.00	3.11
4	019103	国开0808	400,000	38,984,000.00	2.81
5	110021	国债0708	301,530	31,263,089.40	2.26

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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
本基金本报告期末未投资贵金属。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。

2. 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1. 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

2. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。

3. 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注
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。

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。

3. 其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,664,002.94
2	应收证券清算款	12,594,213.23
3	应收股利	-
4	应收利息	2,223,388.69
5	应收申购款	14,093.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,485,747.28

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	43,382,000.00	3.11
2	110011	国债0708	31,263,089.40	2.26
3	113008	光大转债	22,326,420.00	1.61
4	110022	三一转债	5,759,000.00	0.40

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的费用
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2018年1季度及历史各时间阶段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
2006年01月17日至2006年12月31日	-1.56%	0.86%	-1.21%	1.05%	-0.36%	-0.19%
2007年	120.97%	1.16%	74.27%	1.15%	46.54%	0.01%
2008年	114.57%	1.10%	13.65%	1.97%	-16.11%	-0.66%
2009年	-54.49%	2.28%	-54.26%	2.40%	-0.11%	-0.02%
2010年	70.59%	1.62%	66.75%	1.61%	3.84%	0.04%
2011年	0.43%	1.20%	-13.94%	1.25%	14.27%	0.14%
2012年	-28.83%	1.20%	-19.72%	1.01%	-13.11%	0.19%
2013年	-1.04%	1.09%	0.68%	0.95%	-10.27%	0.14%
2014年	2.04%	1.19%	-7.23%	1.13%	9.79%	0.06%
2015年	6.92%	0.99%	42.39%	1.02%	-36.47%	-1.03%
2016年	67.86%	3.14%	2.06%	1.26%	66.80%	0.19%
2017年	-8.16%	1.56%	-2.40%	0.96%	-6.07%	0.60%
2018年	18.93%	0.64%	28.13%	0.68%	-42.09%	0.08%
2018年1月1日至2018年3月31日	2.05%	1.12%	-2.27%	0.89%	5.10%	0.14%