长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信利尚一年定开混合
基金主代码	004607
交易代码	004607
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月17日
报告期末基金份额总额	200,137,634.81份
投资目标	本基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标,在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	在大类资产配置上,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,之后通过密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势,动态调整各大类资产之间的比例,在有效控制基金下行风险的前提下,力争将本基金最大回撤率控制在5%以内。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%
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。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–1,364,575.32
2.本期利润	2,452,855.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0123
4.期末基金资产净值	202,669,949.88
5.期末基金份额净值	1.0127

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	1.23%	0.14%	–0.53%	0.25%	1.76%	–0.11%

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

注:1、本基金基金合同生效日为2017年11月17日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2017年11月17日至2018年9月30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不满一年;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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	长信利丰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	2017年11月17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、长信利发债券型证券投资基金、长信利富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)和长信富安纯债一年定期开放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10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、华富基金管理有限责任公司、华创证券有限责任公司。2017年加入长信基金管理有限责任公司,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。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2018年前三个季度,全球经济进入本轮库存周期的高峰期,中国经济整体领先海外进入库存下降周期,表现为宏观经济的持续放缓,固定投资、工业增加值、社会消费零售的增长乏力,PMI在三季度连续下滑,而社会融资则延续了二季度的缓慢回落的迹象,9月份扣除地方专项债纳入社融的扰动因素甚至单月跌破10%,广义通胀压力随着PPI继续显著的回落,楼市进入调整阶段,总体压力并不大,而CPI的扰动因素依然是季节性的食品涨价和国际博弈导致的油价上涨,内部因素主导的趋势性的非食品价格上涨目前来看压力可控。概括而言,中国经济从滞胀进入衰退期是未来一个季度的主线。

在此背景下,今年1–9月的债券市场整体表现较好,利率债和高评级信用延续了慢牛,短期由于通胀数据和地方专项债发行导致的调整都是阶段性买点,而季末资金面干扰在今年的债券牛市都不构成太大利空。中低评级产业债和城投债,则随着经济下行清算期债务风险暴露,利差略有扩大。债券投资告别了宏观策略时代,进入自下而上的个券甄别和行业研究时代。

本基金债券部分维持中短久期利率债、高等级信用债的底仓配置,特别注重控制压缩久期,精选挖掘优质个券,全力规避信用风险,8–9月随着权益市场持续深度调整适当加大了权益的配置,降低了可转债的配置,以提高组合四季度的安全性和收益性。考虑外部风险尤其是中美博弈的长期深远影响,中国经济大概率回归改革和内需主导,因此权益投资的主线围绕大众消费品和医药行业进行价值投资。

4.4.2 2018年四季度市场展望和投资策略

展望2018年四季度,中国经济的韧性在贸易战的外部冲击下依然可持续,宏观经济出现衰退的概率并不大,但是去库存压力在未来依然存在,地产链条是拖累经济基本面的根源。而政策的宽松和托底短期内能否对冲这种库存下降的波动率冲击,需要更多经济数据和上市公司报表的验证。总体而言,我们依然处于宽货币、紧财政和紧信用的阶段,利率债和商品的强势短期内难以逆转。

具体来看,国内社融增速持续下滑,影响各行各业的增长预期,更多的减税降费、基建刺激、扩大内需的政策仍会持续吹风,而四季度出口对经济的拖累仍在延续,随着人民币再次进入贬值周期,去存库阶段的最大问题,可能依然是总量经济需求不足,受制于去杠杆的地方债务约束,财政政策配合货币政策的发力需要更多的时间来传导。

我们判断债市仍然是一个相当宽松的环境,但是随着三季度偿债高峰过去,地方专项债发行的冲击也褪去,地方平台、民企产业债违约事件目前来看总体可控,总体维持中等期限中高评级信用债和利率债的组合。

权益市场在三季度的表现非常疲软,可转债市场流动性枯竭,四季度如果没有增量资金入场,大概率行情依然维持低迷,随着上证指数跌破10年均线、深圳成指跌破20年均线,以及地方国资陆续启动救助上市公司股质,四季度可以适当参与权益资产的阶段性超跌反弹行情,市场的趋势弱化、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。维持组合目前久期,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为1.0127,累计份额净值为1.0127,本报告期份额净值增长率为1.23%,同期业绩比较基准收益率为–0.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,820,785.14	7.21
	其中:股票	20,820,785.14	7.21
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	247,833,100.00	85.87
	其中:债券	247,833,100.00	85.87
	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	16,222,713.64	5.62
8	其他资产	3,754,217.31	1.30
9	合计	288,630,816.09	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	13,468,000.00	6.65
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	–	–
J	金融业	7,352,785.14	3.63
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	20,820,785.14	10.27

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000333	美的集团	115,000	4,838,050.00	2.39
2	601166	兴业银行	299,000	4,769,050.00	2.35
3	603799	华友钴业	75,000	3,996,750.00	1.97
4	600196	复星医药	120,000	3,786,000.00	1.87
5	600919	江苏银行	399,959	2,583,735.14	1.27
6	300373	扬杰科技	40,000	847,200.00	0.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	64,027,800.00	31.59
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	128,734,800.00	63.52
5	企业短期融资券	35,336,500.00	17.44
6	中期票据	10,159,000.00	5.01
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	9,575,000.00	4.72
9	其他	–	–
10	合计	247,833,100.00	122.28

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债(7)	450,000	46,134,000.00	22.76
2	136629	16兵装01	200,000	19,898,000.00	9.82
3	136519	16陆嘴01	200,000	19,874,000.00	9.81
4	010303	03国债(3)	180,000	17,893,800.00	8.83
5	112358	16BOE01	170,000	16,945,600.00	8.36

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,818.41
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,706,398.90
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,754,217.31

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	4,838,050.00	2.39	临时停牌

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	200,137,634.81
报告期期间基金总申购份额	–
减:报告期期间基金总赎回份额	–
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	200,137,634.81

注:本基金以定期开放方式运作,其封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。

本基金本报告期处于封闭期。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件;

2、《长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站:http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
2018年10月25日

长信全球债券证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定,于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	长信全球债券(QDII)
基金主代码	004998
交易代码	004998
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月11日
报告期末基金份额总额	25,088,294.18份
投资目标	本基金通过积极主动的资产管理,在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下追求本金长期安全的基础上,通过积极和深入的研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。
投资策略	本基金将通过对相关市场的宏观经济状况、市场利率走势、债券利差、证券市场走势、信用风险情况、以及各类资产的不同的风险和回报特征等综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	巴克莱全球债券指数(Barclay Global Aggregate Index)*70%+中债综合指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:–
	中文名称:–
境外资产托管人	英文名称:Brown Brothers Harriman & Co.
	中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

注:1、本基金另设美元份额,基金代码004999,与人民币份额并表披露

2、截止本报告期末,本基金人民币份额净值1.0157元,人民币总份额3,505,693.41份;本基金美元份额净值0.1476美元,美元总份额21,582,600.77份。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	1,124,823.01
2.本期利润	909,226.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0355
4.期末基金资产净值	25,483,050.56
5.期末基金份额净值	1.0157

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;

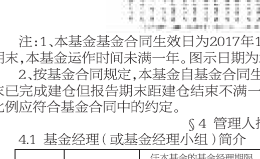
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	3.58%	0.27%	2.20%	0.23%	1.38%	0.04%

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



注:1、本基金基金合同生效日为2017年12月11日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2017年12月11日至2018年9月30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不满一年;建仓期结束时,本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨帆	长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、国际业务部副总监、投资决策委员会执行委员	2017年12月11日	–	12年	工商管理学硕士,北京大学工商管理学硕士毕业,曾在莫尼塔投资发展有限公司担任研究员,敦和资产管理有限公司担任高级研究员,2017年3月加入长信基金管理有限责任公司,曾任长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,现任国际业务部副总监和投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度美国上调基准利率至2%–2.25%,这是年内第三次,也是2015年12月启动加息以来的第八次加息,而对未来利率水平预测的"散点图"上,美联储维持2018年底2.375%、2019年底3.125%、2020年3.375%的预测不变,即对应2018年加息4次、2019年加息3次和2020年加息1次;但小幅上调了中长期利率水平至3%。从美联储的政策口径来看,加息路径尚未调整,美债10年期利率在三季度末四季度初出现一波快速上行行情,目前到了3.1%–3.2%的水平。

汇率方面,随着美元进入加息通道,美元吸引力,美元指数不断走强,资金不断流出新兴市场,三季度人民币继续延续二季度趋势,震荡下调,在三季度中,人民币兑美元贬值3.97%,今年以来贬值幅度扩大到5.28%

债市方面,三季度初随着政策的宽松短久期城投债逐渐收复失地,信用利差不断收缩,带动整体市场情绪有所好转。然而,整体风险没有消散,紧接而来大量的新债发行,以及去杠杆政策行至中途,以及地产紧缩政策仍然严厉,我们认为控制风险仍然是主基调。三季度中资美元债高收益指数收益率为2.21%,投资级别指数收益率为0.58%。

4.5.2 四季度年市场展望和投资策略

在三季度的操作中,我们继续秉持严格控制信用风险,降低低评级债券比例以及控制久期的操作策略。在四季度的操作中,我们将会继续以把控风险为主,在前期受到市场因素调整较大的债券中适当挑选本身基本面没有问题的债券进行配置,提高收益率。

4.5.3 报告期内基金的业绩表现

截止到2018年9月30日,本基金份额净值为1.0157元,份额累计净值为1.0157元。美元份额净值为0.1476美元,份额累计净值为0.1476美元。本报告期内本基金净值增长率为3.58%,业绩比较基准为2.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2017年12月20日至2018年3月19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。截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:普通股	–	–
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	21,643,594.15	84.39
	其中:债券	21,643,594.15	84.39
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	3,685,370.83	14.37
8	其他资产	318,342.33	1.24
9	合计	25,647,307.31	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

注:本基金本报告期末未持有股票及存托凭证

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
AAA+至AAA–	1,948,143.00	7.64
AA+至AA–	256,774.50	1.01
A+至A–	5,135,553.79	20.15
BBB+至BBB–	3,257,668.57	12.78
BB+至BB–	4,469,901.23	17.54
B+至B–	2,107,573.62	8.27
CCC+至CCC	0.00	0.00
未评级	4,467,979.44	17.53

注:本债券投资组合境外债券主要采用标准普尔、惠誉、穆迪等机构提供的债券信用评级信息,境内债券主要采用联合信用评级有限公司等机构提供的债券信息评级信息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	XS1144941439	SUNAC 8 12/05/19	3,000	2,107,573.62	8.27
2	XS0994732401	BOCAVI 4 1/2 11/20/18	19,000	1,900,779.00	7.46
3	US06120TAA60	BCHINA 5 11/13/24	2,500	1,757,893.57	6.90
4	US71647NAS80	PETBRA 7 3/8 01/17/27	2,500	1,749,053.80	6.86
5	US12591DAC56	CNOOC FINANCE 2014 ULC	2,500	1,735,329.79	6.81

注:债券代码为ISIN码。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

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

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	530.79
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	317,611.70
5	应收申购款	199.84
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	318,342.33

5.10.4 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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	888,391.80	3.49
2	113013	国君转债	542,874.00	2.13
3	113011	光大转债	516,877.20	2.03
4	128027	崇达转债	256,774.50	1.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	26,013,212.12
报告期期间基金总申购份额	259,551.71
减:报告期期间基金总赎回份额	1,184,469.65
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	25,088,294.18

注:上述份额变动包含人民币份额及美元份额的情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件;

2、《长信全球债券证券投资基金基金合同》;

3、《长信全球债券证券投资基金招募说明书》;

4、《长信全球债券证券投资基金托管协议》;

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站:http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
2018年10月25日

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

2018年第三季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月19日(基金合同生效日)起至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	长信企业精选两年定开混合
基金主代码	005589
交易代码	005589
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月19日
报告期末基金份额总额	200,934,838.36份
投资目标	本基金通过积极主动的资产管理,在严格控制基金资产风险的前提下,精选各个行业的优质企业进行投资,追求长期稳健的绝对回报。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 (1)资产配置策略 (2)股票投资策略 (3)债券投资策略 (4)其他类型资产投资策略 2、开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*30%+沪深300指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月19日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–619,572.60
2.本期利润	–1,297,389.01
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0065
4.期末基金资产净值	199,637,449.35
5.期末基金份额净值	0.9935

注:1、本基金基金合同生效日为2018年7月19日,截至本报告期末,本基金运作时间未满一个季度;

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

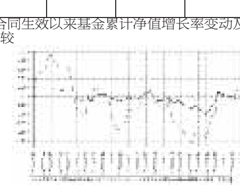
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
自基金合同生效日起至今(2018年7月19日至2018年9月30日)	–0.65%	0.28%	0.02%	0.84%	–0.67%	–0.56%

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



注:1、本基金基金合同生效日为2018年7月19日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2018年7月19日至2018年9月30日。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定:投资于股票资产的比例不低于基金资产的30%,投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%,但在每次开放期前两个月、开放期及开放期结束后两个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。在开放期内,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。在封闭期内,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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。

截至本报告期末,本基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶松	长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势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、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和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的基金经理、权益投资部总监	2018年7月19日	–	11年	经济学硕士,中南财经政法大学投资学专业研究生毕业。2007年7月加入长信基金管理有限责任公司,担任行业研究员,从事行业和上市公司研究工作,曾任基金经理助理、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金和长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、绝对收益部总监。现任权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势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、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和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;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准;

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场出现大幅波动,企业精选仍在建仓期。按照市场下探幅度分批加仓,目前配置了化工、金融、地产、基建等行业。

在目前时点,我们认为四季度是年内的一个反弹窗口。随着美国对中国2000亿美元出口商品征税方式以及时间的落地,我们认为贸易战开始进入一个阶段性观察期。即便后续仍有一些小的升级动作,我们认为其边际影响也在减弱。而作为应对,我们预计在四季度会看到政府一些列的扩内需措施。这都为市场反弹创造了较为良好的外部环境。而三季度的回调也使得市场的风险得到进一步的释放,为反弹打下了较为扎实的估值基础。但从中期看,市场仍处在一个磨底的过程中。中国经济本轮库存周期在18年1季度见顶后其下行的过程仍未结束,特别是房地产行业的下行给经济带来的压力还需要几个季度去消化。并且贸易战对于经济产生的实际影响也会在未来几个季度逐渐显现出来。企业景气下行导致的盈利趋势走弱可能会持续几个季度。而且从历史上看,在美国扩张周期的后半段,新兴市场往往承受着较大压力,新兴市场在未来一两个季度出现系统性风险的概率仍在提升。因此,在这些风险释放之前市场可能都会处在一个不断磨底的过程中。而真正新一轮牛市的开启我们需要观察到几个因素,中国经济触底、美国加息周期的结束、深化改革的持续推进。从时间上我们没法精确地判断牛市何时会来,但从空间上我们觉得这个位置风险收益比是比较高的。在布局层面,我们分两层看。第一层,A股的优质龙头,过去两年的行情市场已经给我们梳理得很清晰了,随着A股国际化趋势的加深以及养老、社保等长线资金的逐步入场,未来这些优质资产的波动性会明显减弱。而18年的熊市则给了我们再次便宜买好货的机会。第二层,从产业发展的角度来看,消费和科技创新领域是必须要重视的。随着经济的不断增长以及人口结构的变化,消费在经济结构中的占比在不可逆的逐步增大。消费的螺旋式升级以及不断扩张的消费品类给市场带来了众多的机会。而在科技创新领域,国产替代的进程仍在快速推进,各个细分行业不断有龙头涌现,并且在A股港股市场陆续登场。我们需要用更加积极的心态,好好利用市场给我们的机会,将那些占据好赛道,真正拥有竞争壁垒的公司挑出来进行布局。

4.5 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0.9935元,累计份额净值为0.9935元。本报告期内本基金净值增长率为–0.65%,同期业绩比较基准收益率为0.02%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,127,680.50	31.32
	其中:股票	65,127,680.50	31.32
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	100,000,000.00	48.09
	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	42,722,690.23	20.55
8	其他资产	88,570.58	0.04
9	合计	207,938,941.31	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	39,498,080.50	19.78
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	5,752,000.00	2.88
J	金融业	15,017,600.00	7.52
K	房地产业	4,860,000.00	2.43
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	65,127,680.50	32.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603808	歌力思	477,719	8,360,082.50	4.19
2	300196	长海股份	828,400	7,952,640.00	3.98
3	601689	拓普集团	400,000	6,600,000.00	3.31
4	601336	新华保险	120,000	6,057,600.00	3.03
5	300383	光环新网	400,000	5,752,000.00	2.88
6	000002	万 科A	200,000	4,860,000.00	2.43
7	002643	万润股份	485,300	4,785,058.00	2.40
8	601398	工商银行	800,000	4,616,000.00	2.31
9	601939	建设银行	600,000	4,344,000.00	2.18
10	600141	兴发集团	340,000	4,243,200.00	2.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,154.54
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	72,416.04
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	88,570.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300383	光环新网	5,752,000.00	2.88	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年7月19日)基金份额总额	200,934,838.36
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	200,934,838.36

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	28,199,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	28,199,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	14.03

注:基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	认购	2018年7月19日	28,199,000.00	28,200,000.00	–
合计			28,199,000.00	28,200,000.00	

注:基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行,上述认购适用费率为固定费率,单笔1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件;

2、《长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《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招募说明书》;

4、《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托管协议》;

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿;

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站:http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
2018年10月25日