

## 信息披露

## Disclosure

## 长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2019年半年度报告摘要

基金管理人：长信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国民生银行股份有限公司  
送出日期：2019年8月27日

## 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其从业人员在基金业务活动中，应当遵守《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、取信于社会投资者公众为宗旨，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。

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明  
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、取信于社会投资者公众为宗旨，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 管理人对于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  
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  
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 管理人对于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年上半年，利率债走势先抑后扬，一季度资金宽松预期和风险偏好回升共同驱动债市，债市收益率维持窄幅震荡，10年期国债波动幅度约40BP，底部格局有所抬升。二季度利率从此前的期限好转向波动风险偏好修复，进入数据实际好转的情况现期。3月金融、经济数据均表现亮丽，同时政策层对当前经济局势的表态也支持了此前逆周期调节效果，市场快速反应经济好转预期。而后，在市场利率释放较为充分的情况下，收益率在4月底迎来预期差的一波修复。本组合调整了持仓结构，提高了票息收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截至本报告期末，本基金份额净值为1.0364元，份额累计净值为1.0364元，本报告期末本基金份额净值增长率为2.07%，同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望后市，有四点值得注意：一是地产调控的升温或导致房地产融资承压，对社融的支撑力度或减弱。二是随着非标准低基数效应的减弱，非标准融资同比改善对社融的拉动力度或减弱。三是包商事件对信用层面的冲击或将导致企业中长期贷款走弱，而非存款类机构贷款仍然走强。四是在去年三季度的高基数下，地方专项债发行对社融形成持续拉动。考虑到经济基本面的下行压力以及风险事件的发酵，利率下行方向确定，同时由于收益率绝对水平已较低，下行的空间和节奏上预计有波折。下阶段货币政策的重点仍在稳增长、防风险、调结构之间寻求平衡，利率债的交易估计也在震荡中呈现机会。

信用债方面，“包商事件”使得信用债信用有所收缩，可能使后续信用修复速度放缓，由于机配需求持续地集中于高等级信用债，AAA品种下历史地位的机配有所延续，低等级信用债利差易上难下。操作上，后续我们将继续控制在风险的前提下，挖掘优质短久期品种进行配置。下半年预计资金面会维持合理充裕，希望能在票息+杠杆+骑乘效应中取得平衡。

4.6 管理人对于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、估值方法以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的合规性进行复核和审阅，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。基金经理直接参与估值决策，估值决策由与估值工作小组委员1/2以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司可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有效性。

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 管理人对于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、本基金在符合基金法定分红的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况随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；若投资者选择不选择，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、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对于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遵守信情况声明  
报告期内，中国民生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》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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遵守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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  
本托管人复核检查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

5.4 半年度财务数据（未经审计）  
6.1 资产负债表  
会计主体：长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
报告截止日：2019年6月30日

| 资产         | 本报告期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|------------|---------------------|---------------------|
| 资产：        |                     |                     |
| 银行存款       | 2,777,056.62        | 473,001.70          |
| 结算备付金      | 4,982,981.69        | -                   |
| 存出保证金      | 38,421.36           | 1,897.46            |
| 交易性金融资产    | 689,289,000.68      | 581,781,000.00      |
| 基金投资       | -                   | -                   |
| 债券投资       | 689,289,000.68      | 581,781,000.00      |
| 资产支持证券投资   | -                   | -                   |
| 衍生金融资产     | -                   | -                   |
| 其他金融资产     | -                   | -                   |
| 买入返售金融资产   | -                   | -                   |
| 应收证券清算款    | -                   | -                   |
| 预付款项       | -                   | -                   |
| 应收利息       | 11,503,968.89       | 8,834,878.01        |
| 应收股利       | -                   | -                   |
| 其他应收款      | -                   | -                   |
| 其他资产       | -                   | -                   |
| 资产总计       | 708,591,622.12      | 591,130,987.17      |
| 负债和所有者权益   |                     |                     |
| 负债：        |                     |                     |
| 短期借款       | -                   | -                   |
| 应付证券清算款    | -                   | -                   |
| 应付赎回款      | -                   | -                   |
| 应付债券       | -                   | -                   |
| 应付利息       | 129,264.42          | 119,544.09          |
| 应付管理人报酬    | 43,088.14           | 39,381.24           |
| 应付托管费      | -                   | -                   |
| 其他负债       | -                   | -                   |
| 所有者权益      | 9,971.73            | 13,653.88           |
| 实收基金       | 70,456.66           | 81,016.72           |
| 未分配利润      | 51,403.92           | 11,022.03           |
| 所有者权益合计    | 80,460.65           | 94,670.81           |
| 负债和所有者权益总计 | 708,591,622.12      | 591,130,987.17      |

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0364元，基金份额总额707,005,516.15份。

2、本基金合同于2018年8月31日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表  
会计主体：长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

| 项目                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|----------------------------|
| 一、收入                | 16,078,268.70              | -                          |
| 1.利息收入              | 16,150,504.88              | -                          |
| 其中：存款利息收入           | 54,918.22                  | -                          |
| 债券利息收入              | 16,091,036.47              | -                          |
| 资产支持证券投资收入          | -                          | -                          |
| 买入返售金融资产收入          | 4,551.18                   | -                          |
| 其他利息收入              | -                          | -                          |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）    | -1,086,150.59              | -                          |
| 其中：股票投资收益           | -                          | -                          |
| 基金投资收益              | -1,086,150.59              | -                          |
| 资产处置收益              | -                          | -                          |
| 公允价值变动收益（损失以“-”填列）  | 24,004.43                  | -                          |
| 4.其他收入（损失以“-”填列）    | -                          | -                          |
| 二、费用                | 4,485,647.65               | -                          |
| 1.管理人报酬             | 778,997.75                 | -                          |
| 2.托管费               | 258,698.88                 | -                          |
| 3.销售服务费             | -                          | -                          |
| 4.交易费用              | 9,964.30                   | -                          |
| 5.利息支出              | 3,267,637.74               | -                          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | 3,267,637.74               | -                          |
| 6.其他费用              | 40,000.87                  | -                          |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 10,619,711.05              | -                          |
| 减：所得税费用             | -                          | -                          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 10,619,711.05              | -                          |

注：1、本报告期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  
本基金本报告期无应付关联方交易单元的费用。  
6.4.7.2 关联方报酬  
6.4.7.2.1 基金管理费

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 778,997.75                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.2 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目                                                                                                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                      | 258,698.88                 | -                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费                                                                                     | -                          | -                          |
| 注：1、本基金基金合同于2018年8月31日正式生效，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×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当月天数。 |                            |                            |
| 6.4.7.2.3 基金托管费                                                                                     |                            |                            |

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|