

(上接A55版)

度等方面的分析,形成对资产证券化的风险和收益进行综合评估,同时依据资产支持证券的定价模型,确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上,本基金通过建立波动率模型、测算可能违约的损失概率,对资产支持证券进行跟踪和测评,从而有效防范投资风险和控制。

(3) 基金进行股指期货投资策略
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险,对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准:中证300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较的指数时,基金管理人可以以维护基金份额持有人利益为出发点,按照基金合同约定变更业绩比较基准或权重,业绩比较基准的变更无需经基金管理人及基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险控制特征
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合同约定,于2019年9月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2019年6月30日(摘自本基金2019年第二季度报告),本报告中列示的数据未经审计。

(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	76,322,803.00	21.83
2	其中:股票	76,322,803.00	21.83
3	债券投资	-	-
4	固定收益投资	243,096,086.00	70.36
5	其中:债券	243,096,086.00	70.36
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	10,000,000.00	2.89
10	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	13,826,511.99	4.03
12	其他资产	3,296,421.24	0.95
13	合计	346,519,822.43	100.00

注:本基金本报告期末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	-	-
B	采矿业	209,673.65	0.06
C	制造业	32,394,936.19	9.30
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	13,011,592.89	3.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	22,073,916.00	6.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,579,576.00	2.20
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	建筑业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文体、体育和娱乐业	24,106.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	76,322,803.00	21.83

2. 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合
本基金本报告期末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

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约定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	29,549,618.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,296,421.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,296,421.24

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

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。

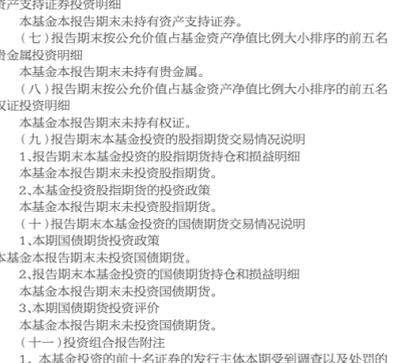
6、投资组合报告期末其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩归因
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

(一) 基金各时间阶段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	业绩比较基准收益率②	①-②
2015年2月11日-2015年12月31日	36.40%	0.91%	11.78%
2016年	-21.48%	1.30%	-7.07%
2017年	11.58%	0.21%	5.14%
2018年	6.07%	0.18%	-1.58%
2019年1月1日-2019年1月31日	0.97%	0.35%	14.20%
2019年4月1日-2019年6月30日	2.00%	0.30%	-1.88%

(二) 自合同生效之日(2015年2月11日)至2019年6月30日期间,本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比:



注:1. 图示日期为2015年2月11日至2019年6月30日。

2. 按基金合同约定,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应符合基金合同的约定。

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4. 《基金合同》生效后与基金相关的诉讼费、律师费、诉讼费及仲裁费;

5. 基金销售持有人大会费用;

6. 基金的证券交易费用;

7. 基金的银行汇划费用;

8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2. 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3. 其他费用
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

(二) 基金销售有关费用
投资者在申购本基金的申购费用,申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有单笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额(M,含申购费)	前端申购费率
100元<M<500元	1.5%
500元≤M	1.0%/每笔

注:M为申购金额
投资者选择红利再投资所转成的份额不收取申购费用。

(2) 场内申购费用
投资者在场内申购本基金时缴纳申购费用。本基金的场内申购费率与上述规定的场外申购费率一致。

2. 赎回费用
本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,赎回费率随持有时间的增加而递减,场内赎回赎回费率如下:

持有时间(Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<30天	0.5%
30天≤Y<6个月	0%
Y≥6个月	0%

注:Y为持有年限

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50%计入基金财产;对于持有期长于3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赎回费和必要的服务费。

3. 基金转换
本基金已开通了长信新利混合基金与长信利息收益货币基金A、B级精选混合基金(A级代码:519999;B级代码:519998)(非直销渠道)、长信红利精选混合基金(前端代码:519997)、长信金利趋势混合基金(前端代码:519995)、长信增利动态混合基金(前端代码:519993)、长信纯债壹号债券基金A类份额(A类代码:519985)、长信量化先锋混合基金A类份额(A类代码:519983)、长信红利混合基金、长信利丰债券基金C类份额(C类代码:519989)、长信红利优选混合基金A类份额(A类代码:519991)、长信内源成长混合基金A类份额(A类代码:519979)、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信利富债券基金、长信成长多策略股票基金A类份额(A类代码:519965)、长信利盈混合基金、长信红利混合基金、长信多利混合基金、长信普混混合基金、长信利发混合基金、长信利泰混合基金、长信利发债券基金、长信先优债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利混合基金A类份额(A类代码:519944)、长信上证500指数定投发起基金、长信先优债券基金、长信中证500指数基金、长信乐信混合基金(非直销渠道)、长信低碳环保混合股票基金、长信消费精选股票基金(非直销渠道)、长信信利优选混合基金、长信利率债债券基金、长信利合混合基金之间的双向转换业务。

本公司于2017年6月30日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证500指数型发起式证券投资基金暂停转出和转换转入业务的公告》,自2017年7月4日起,暂停长信上证500指数型发起式

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约定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	29,549,618.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,296,421.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,296,421.24

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

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、投资组合报告期末其他文字描述部分
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、基金的业绩归因
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

(一) 基金各时间阶段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	业绩比较基准收益率②	①-②
2015年2月11日-2015年12月31日	36.40%	0.91%	11.78%
2016年	-21.48%	1.30%	-7.07%
2017年	11.58%	0.21%	5.14%
2018年	6.07%	0.18%	-1.58%
2019年1月1日-2019年1月31日	0.97%	0.35%	14.20%
2019年4月1日-2019年6月30日	2.00%	0.30%	-1.88%

(二) 自合同生效之日(2015年2月11日)至2019年6月30日期间,本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比:



注:1. 图示日期为2015年2月11日至2019年6月30日。

2. 按基金合同约定,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应符合基金合同的约定。

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4. 《基金合同》生效后与基金相关的诉讼费、律师费、诉讼费及仲裁费;

5. 基金销售持有人大会费用;

6. 基金的证券交易费用;

7. 基金的银行汇划费用;

8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2. 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3. 其他费用
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

(二) 基金销售有关费用
投资者在申购本基金的申购费用,申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有单笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额(M,含申购费)	前端申购费率
100元<M<500元	1.5%
500元≤M	1.0%/每笔

注:M为申购金额
投资者选择红利再投资所转成的份额不收取申购费用。

(2) 场内申购费用
投资者在场内申购本基金时缴纳申购费用。本基金的场内申购费率与上述规定的场外申购费率一致。

2. 赎回费用
本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,赎回费率随持有时间的增加而递减,场内赎回赎回费率如下:

持有时间(Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<30天	0.5%
30天≤Y<6个月	0%
Y≥6个月	0%

注:Y为持有年限

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50%计入基金财产;对于持有期长于3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赎回费和必要的服务费。

3. 基金转换
本基金已开通了长信新利混合基金与长信利息收益货币基金A、B级精选混合基金(A级代码:519999;B级代码:519998)(非直销渠道)、长信红利精选混合基金(前端代码:519997)、长信金利趋势混合基金(前端代码:519995)、长信增利动态混合基金(前端代码:519993)、长信纯债壹号债券基金A类份额(A类代码:519985)、长信量化先锋混合基金A类份额(A类代码:519983)、长信红利混合基金、长信利丰债券基金C类份额(C类代码:519989)、长信红利优选混合基金A类份额(A类代码:519991)、长信内源成长混合基金A类份额(A类代码:519979)、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信利富债券基金、长信成长多策略股票基金A类份额(A类代码:519965)、长信利盈混合基金、长信红利混合基金、长信多利混合基金、长信普混混合基金、长信利发混合基金、长信利泰混合基金、长信利发债券基金、长信先优债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利混合基金A类份额(A类代码:519944)、长信上证500指数定投发起基金、长信先优债券基金、长信中证500指数基金、长信乐信混合基金(非直销渠道)、长信低碳环保混合股票基金、长信消费精选股票基金(非直销渠道)、长信信利优选混合基金、长信利率债债券基金、长信利合混合基金之间的双向转换业务。

本公司于2017年6月30日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证500指数型发起式证券投资基金暂停转出和转换转入业务的公告》,自2017年7月4日起,暂停长信上证500指数型发起式

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约定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	29,549,618.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,296,421.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,296,421.24

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

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、投资组合报告期末其他文字描述部分
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、基金的业绩归因
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

(一) 基金各时间阶段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	业绩比较基准收益率②	①-②
2015年2月11日-2015年12月31日	36.40%	0.91%	11.78%
2016年	-21.48%	1.30%	-7.07%
2017年	11.58%	0.21%	5.14%
2018年	6.07%	0.18%	-1.58%
2019年1月1日-2019年1月31日	0.97%	0.35%	14.20%
2019年4月1日-2019年6月30日	2.00%	0.30%	-1