

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2017年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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、完整性和及时性承担法律责任。

基金托管人和召集基金份额持有人会议的有限责任公司保证本报告中的财务数据等内容真实准确，但不对本基金的财务状况或经营成果承担责任。

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。

本基金自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信上证港股通指数型发起式证券投资基金
交易代码	510901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
报告期末基金资产净值	15,200,000.00元

报告期末基金份额净值

投资目标

本基金通过股票型指数基金，通过投资标的指数成分股以及跟踪标的指数的被动管理方法，力争基金净值增长率与业绩基准收益率之间的差距最小化，从而实现基金资产的保值增值。

投资策略

本基金通过股票型指数基金，通过投资标的指数成分股以及跟踪标的指数的被动管理方法，力争基金净值增长率与业绩基准收益率之间的差距最小化，从而实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准

99%×上证港股通指数+1%×同期银行存款利率(税后)

风险收益特征

本基金为股票型基金，风险收益特征较高，债券基金与货币市场基金的风险、收益与本基金有本质的区别。

基金管理人

长信基金管理有限责任公司

基金托管人

国泰君安证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币

主要财务指标 报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 108,447.71

2.本期利润 1,113,269.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0060

4.期末基金资产净值 10,500,546.02

5.期末基金份额净值 1.071

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.根据国家有关规定，基金在首次公开募集之日起6个月内进入建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同的约定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于上证港股通指数成份股的比例不低于80%；现金等价物、现金类资产以及到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%。

3.2.2 本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

图示了本基金合同生效日至2017年3月31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。

显示日期:2016年12月16日至2017年3月31日

2.按基金合同的规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内进入建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同的约定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于上证港股通指数成份股的比例不低于80%；现金等价物、现金类资产以及到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%。

注: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间 证券从业年限 说明

薛天 长信美国股票普尔100等权重指数型发起式证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债债券型证券投资基金、长信货币市场基金基金经理 2016年12月16日 - 20年

注:1.本基金因基金经理任期届满而变更基金经理，新增或变更后更更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的从业年限从本基金正式进入证券业并担任相关机构的工作经历之日算起。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金基金经理的变更情况

4.1.1 公开披露的重大事项

注:1.基金经理在任期内以本基金成立之日为准；新增或变更后更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的变更由基金管理人公告并报中国证监会备案。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金基金经理的变更情况

4.1.2 公平交易制度的执行情况

注:1.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

2.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

5. 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 16,890,268.14 83.61

2 货币市场工具 5,800,000.00 36.39

3 固定收益投资 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

6 其他应收款 - -

7 银行存款和结算备付金合计 16,390,268.14 100.00

注:1.本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为16,890,268.14元,占资产净值比例83.61%。

2.本报告期内未按行业分类的股票投资组合

3.2.1 本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

图示了本基金合同生效日至2017年3月31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。

显示日期:2016年12月16日至2017年3月31日

2.按基金合同的规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内进入建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同的约定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于上证港股通指数成份股的比例不低于80%；现金等价物、现金类资产以及到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%。

注: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间 证券从业年限 说明

薛天 长信美国股票普尔100等权重指数型发起式证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债债券型证券投资基金、长信货币市场基金基金经理 2016年12月16日 - 20年

注:1.本基金因基金经理任期届满而变更基金经理，新增或变更后更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的从业年限从本基金正式进入证券业并担任相关机构的工作经历之日算起。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金基金经理的变更情况

4.1.1 公开披露的重大事项

注:1.基金经理在任期内以本基金成立之日为准；新增或变更后更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的变更由基金管理人公告并报中国证监会备案。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金基金经理的变更情况

4.1.2 公平交易制度的执行情况

注:1.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

2.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

5. 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 16,890,268.14 83.61

2 货币市场工具 5,800,000.00 36.39

3 固定收益投资 - -

4 货币市场基金 - -

5 其他资产 - -

6 其他应收款 - -

7 银行存款和结算备付金合计 16,390,268.14 100.00

注:1.本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为16,890,268.14元,占资产净值比例83.61%。

2.所列金额不包括持有人交易费用，例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金赎回费、基金转换费等，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.2 本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

图示了本基金合同生效日至2017年3月31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。

显示日期:2016年10月26日至2017年3月31日

2.按基金合同的规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内进入建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同的约定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于上证港股通指数成份股的比例不低于80%；现金等价物、现金类资产以及到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的5%。

注: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间 证券从业年限 说明

薛天 长信美国股票普尔100等权重指数型发起式证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债债券型证券投资基金、长信货币市场基金基金经理 2016年10月26日 - 20年

注:1.本基金因基金经理任期届满而变更基金经理，新增或变更后更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的从业年限从本基金正式进入证券业并担任相关机构的工作经历之日算起。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承原基金经理的职责，履行原基金经理的职责，新任基金经理的任职资格、从业年限、投资风格、投资理念等均保持不变，新任基金经理的变更不影响本基金的正常运作。

4.本基金基金经理的变更情况

4.1.1 公开披露的重大事项

注:1.基金经理在任期内以本基金成立之日为准；新增或变更后更换基金经理的公告披露日为当月最后一个工作日，即2017年4月22日。

2.本基金基金经理的变更由基金管理人公告并报中国证监会备案。

3.本基金因基金经理变更，新任基金经理将继承