

长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
送出日期:2018年08月29日
\$ 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金在封闭期内不办理申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。
本基金在开放期内的每个工作日开放申购、赎回业务。

2. 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称 长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码 006262
基金式方式 封闭型开放式
基金合同生效日 2018年04月12日
基金管理人 长江证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人 浙商银行股份有限公司
报告期天数/金额/份额 510,000,000份
基金合同终止 不适用

2.2 基金产品说明
投资目标 在控制组合波动率的前提下,力争长期实现超越业绩比较基准的投资回报。
本基金分析宏观经济环境和政策研究,行业配置研究,公司研究,并结合对利率走势的判断,通过资产配置,精选个券,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略 本基金管理人认为债券类资产具有低风险、低波动性的特点,且在当前市场环境下,信用类资产的预期收益相对较高,因此本基金将主要投资于信用类资产,同时适当配置部分股票类资产。
投资基准 本基金为发起式基金,基金合同生效日为2018年4月12日,截至本报告期末尚未满三年,暂不适合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。
投资范围 本基金主要投资于固定收益类金融工具,其比例范围不低于基金资产净值的90%。其中,投资于货币市场工具的比例范围为0-100%;投资于债券的比例范围为0-100%;投资于企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易的可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券的比例范围为0-30%;投资于股票的比例范围为0-20%;投资于权证的比例范围为0-5%;投资于股指期货、国债期货的比例范围为0-10%;投资于股票型基金、混合型基金的比例范围为0-20%;投资于商品基金的比例范围为0-10%;投资于其他金融工具的比例范围为0-10%。
投资限制 本基金不得投资于股票、股票型基金、混合型基金、商品基金、权证等金融工具。
风险特征 本基金为定期开放型债券基金,其风险收益特征与货币市场基金、债券基金类似。

2.3 管理人和基金托管人
项目 基金管理人 基金托管人
名称 长江证券(上海)资产管理有限公司
地址 上海市浦东新区世纪大道1188号世纪汇一座27层
联系人 蔡晓霞
电话 4001-100-000
电子邮箱 gxyqy@zjzq.com
客户服务电话 4001-100-000
传真 021-86001300
联系人 朱丽
电话 0671-47060000
电子邮箱 zhlu@zjzq.com
客户服务电话 4001-100-000
传真 0671-82069000

2.4 信息披露方式
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 www.zjzq.com
基金半年度报告备置地点 上海市浦东新区世纪大道1188号世纪汇一座27层

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元

投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定,本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由首席风控官、营运总监、基金经理、研究员、行业分析师、合规风控部、风险管理部、监察稽核部、信息技术部等相关部门人员组成,估值委员会成员均具有会计核算经验。行业分析师经验、基金工具应用等丰富的证券投资从业经验和专业能力,且之间存在良好的沟通和交流。基金经理认为基金有更准确地反映公允价值的估值方法,可以向估值委员会申请对其作出专项评估。新的估值方法经估值委员会和托管行同意后才能使用,否则将不改变采用现有估值办法。估值委员会职责,根据相关法律法规原则确定估值政策和估值模型,拟定公司的估值政策,估值方法和估值程序,确保拟订各基金持有的公允价值,以维护广大投资者的利益。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有一定比例或基金净资产净值情形的说明

本基金资产于首次购买时即确认为投资成本,并在基金合同有效期内,按基金合同约定的估值方法,计算基金净资产净值变动情况。

4.9 报告期内基金持有人数及基金资产净值变动情况、报告期末基金资产净值总额

4.10 重要提示
本基金目前无重大影响基金的事项。

4.11 基金管理人及其管理基金的基金

4.12 基金经理(基金经理助理)/基金经理助理简介

4.13 管理人对报告期内基金运作情况的说明

4.14 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.15 管理人对基金未来估值安排的说明

4.16 基金销售机构

4.17 基金登记机构

4.18 基金交易场所

4.19 基金估值

4.20 基金费用计提方法、计提标准、支付方式

4.21 基金收益分配原则、时间、方式

4.22 基金费用税率、税项

4.23 基金的税收

4.24 基金的费用

4.25 基金的收益

4.26 基金的财产

4.27 基金的负债

4.28 基金的资产

4.29 基金的净值

4.30 基金的资产净值

4.31 基金的负债净值

4.32 基金的资产总额

4.33 基金的负债总额

4.34 基金的净资产

4.35 基金的资产净值

4.36 基金的负债净值

4.37 基金的资产总额

4.38 基金的负债总额

4.39 基金的净资产

4.40 基金的资产净值

4.41 基金的负债净值

4.42 基金的资产总额

4.43 基金的负债总额

4.44 基金的净资产

4.45 基金的资产净值

4.46 基金的负债净值

4.47 基金的资产总额

4.48 基金的负债总额

4.49 基金的净资产

4.50 基金的资产净值

4.51 基金的负债净值

4.52 基金的资产总额

4.53 基金的负债总额

4.54 基金的净资产

4.55 基金的资产净值

4.56 基金的负债净值

4.57 基金的资产总额

4.58 基金的负债总额

4.59 基金的净资产

4.60 基金的资产净值

4.61 基金的负债净值

4.62 基金的资产总额

4.63 基金的负债总额

4.64 基金的净资产

4.65 基金的资产净值

4.66 基金的负债净值

4.67 基金的资产总额

4.68 基金的负债总额

4.69 基金的净资产

4.70 基金的资产净值

4.71 基金的负债净值

4.72 基金的资产总额

4.73 基金的负债总额

4.74 基金的净资产

4.75 基金的资产净值

4.76 基金的负债净值

4.77 基金的资产总额

4.78 基金的负债总额

4.79 基金的净资产

4.80 基金的资产净值

4.81 基金的负债净值

4.82 基金的资产总额

4.83 基金的负债总额

4.84 基金的净资产

4.85 基金的资产净值

4.86 基金的负债净值

4.87 基金的资产总额

4.88 基金的负债总额

4.89 基金的净资产

4.90 基金的资产净值

4.91 基金的负债净值

4.92 基金的资产总额

4.93 基金的负债总额

4.94 基金的净资产

4.95 基金的资产净值

4.96 基金的负债净值

4.97 基金的资产总额

4.98 基金的负债总额

4.99 基金的净资产

4.10 基金的资产净值

4.11 基金的负债净值

4.12 基金的资产总额

4.13 基金的负债总额

4.14 基金的净资产

4.15 基金的资产净值

4.16 基金的负债净值

4.17 基金的资产总额

4.18 基金的负债总额

4.19 基金的净资产

4.20 基金的资产净值

4.21 基金的负债净值

4.22 基金的资产总额

4.23 基金的负债总额

4.24 基金的净资产

4.25 基金的资产净值

4.26 基金的负债净值

4.27 基金的资产总额

4.28 基金的负债总额

4.29 基金的净资产

4.30 基金的资产净值

4.31 基金的负债净值

4.32 基金的资产总额

4.33 基金的负债总额

4.34 基金的净资产

4.35 基金的资产净值

4.36 基金的负债净值

4.37 基金的资产总额

4.38 基金的负债总额

4.39 基金的净资产

4.40 基金的资产净值

4.41 基金的负债净值

4.42 基金的资产总额

4.43 基金的负债总额

4.44 基金的净资产

4.45 基金的资产净值

4.46 基金