# 长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金 2018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:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行",下同)根据本基金基金合同的规定,于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

1.1

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长信标普100等权重指数(QDII) |
| 场内简称 | 长信标普100 |
| 基金主代码 | 519981 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年3月30日 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 25,152,233.52份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值。通过严格的投资纪律的策略数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔100等权重指数(本基金的标的指数,以下简称"标普100等权重指数")收益率之间的日均跟踪误差控制在0.50%以内,相应的年化跟踪误差控制在7.94%以内。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究,力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。 |
| 投资策略 | 本基金为股票指数增强型基金,期则上不少于80%的基金净资产采用完全复制法,按照成份股在标普100等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变化,进行相应的调整。对于不高于基金净资产15%的主动投资部分,基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断,在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为具有中长期或长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种,货币市场工具,金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。 |
| 业绩比较基准 | 标准普尔100等权重指数总收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票指数增强型基金,本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关,为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 长信基金管理有限责任公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfundcom.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 95566 |
| 传真 | | 021-61009800 | 010-66594942 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | - | Bank Of China (Hong Kong)Limited |
| | 中文 | - | 中国银行(香港)有限公司 |
| 注册地址 | | - | 香港花园道1号中银大厦 |
| 办公地址 | | - | 香港花园道1号中银大厦 |
| 邮政编码 | | - | - |

2.5 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.cxfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路68号9楼、北京市西城区复兴门内大街1号 |

## §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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日-2018年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 232,504.66 |
| 本期利润 | -497,333.17 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0178 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.63% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0967 |
| 期末基金资产净值 | 30,900,287.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.229 |

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。

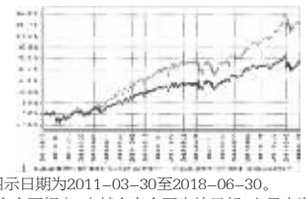
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 3.45% | 0.52% | 0.46% | 0.51% | 2.99% | 0.01% |
| 过去三个月 | 6.78% | 0.69% | 4.54% | 0.68% | 2.24% | 0.01% |
| 过去六个月 | -0.65% | 0.95% | -0.02% | 0.98% | -0.63% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.42% | 0.73% | 11.41% | 0.74% | -6.99% | -0.01% |
| 过去三年 | 25.66% | 0.75% | 34.17% | 0.85% | -8.51% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 79.07% | 0.84% | 134.21% | 0.94% | -55.14% | -0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、图示日期为2011-03-30至2018-06-30。

2、按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准,由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.65亿元人民币。目前股权结构为:长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心(有限合伙)占4.55%、上海彤骏投资管理中心(有限合伙)占4.54%。

截至2018年6月30日,本基金管理人共管理61只开放式基金,即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富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、长信利广灵活配置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、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证500指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨帆 | 长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、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和长信全球债券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4月20日 | - | 12年 | 工商管理学硕士,北京大学工商管理学硕士毕业,曾在易经投资发展有限公司担任研究员、微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,现任国际业务部副总监和投资决策委员会执行委员,长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、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和长信全球债券证券投资基金的基金经理。 |
| 傅瑶纯 | 长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理助理 | 2017年5月9日 | - | 3年 | 金融学硕士,毕业于英国华威大学,具有基金从业资格,曾任银行中国农业银行上海市分行、易略思商务咨询有限公司,2016年4月加入长信基金管理有限责任公司,现任长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。 |

注:本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长信基金管理有限责任公司(以下简称"长信基金") | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中国银行(香港)有限公司(以下简称"中银香港") | 基金境外托管人 |

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 基金交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.7.1.5 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 183,705.06 | 452,643.73 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 85,440.84 | 88,329.20 |

注:支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.1%的年费率确认,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.1%/当年天数

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 50,101.33 | 123,448.30 |

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.3%的年费率确认,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 10,001,888.88 | 10,001,888.88 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,001,888.88 | 10,001,888.88 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 39.77% | 22.78% |

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公布的费率执行。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 245,542.08 | 4,632.23 | 4,936,257.94 | 32,158.66 |
| 中国银行(香港) | 2,194,403.07 | - | 4,517,656.86 | - |

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注:上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。本基金非基金中基金,不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 28,986,081.23 | 92.03 |
| | 其中:普通股票 | 28,986,081.23 | 92.03 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 2,439,945.15 | 7.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 70,960.79 | 0.23 |
| 9 | 合计 | 31,496,987.17 | 100.00 |

注:本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

| 国家(地区) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 美国 | 28,986,081.23 | 93.81 |
| 合计 | 28,986,081.23 | 93.81 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 保健 | 4,083,474.66 | 13.22 |
| 必需消费品 | 3,646,098.13 | 11.80 |
| 材料 | 264,316.76 | 0.86 |
| 电信服务 | 1,131,856.37 | 3.66 |
| 非必需消费品 | 3,947,997.66 | 12.78 |
| 工业 | 3,591,147.88 | 11.62 |
| 公共事业 | 1,467,499.03 | 4.75 |
| 金融 | 4,713,211.08 | 15.25 |
| 能源 | 1,906,710.39 | 6.17 |
| 信息技术 | 4,233,769.27 | 13.70 |
| 合计 | 28,986,081.23 | 93.81 |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | FACEBOOK INC-A | Facebook公司 | FB US | 纳斯达克 | 美国 | 404 | 519,438.04 | 1.68 |
| 2 | WALT DISNEY CO/THE | 沃尔特迪斯尼 | DIS US | 纽交所 | 美国 | 746 | 517,340.44 | 1.67 |
| 3 | US BANCORP | 美国合众银行 | USB US | 纽交所 | 美国 | 1,524 | 504,386.59 | 1.63 |
| 4 | KRAFT HEINZ CO/THE | 卡夫亨氏 | KHC US | 纳斯达克 | 美国 | 1,126 | 468,027.32 | 1.51 |
| 5 | SOUTHERN CO | 南方 | SO US | 纽交所 | 美国 | 1,472 | 451,042.51 | 1.46 |
| 6 | Charter Communications Inc | 特许通讯公司 | CHTR US | 纳斯达克 | 美国 | 226 | 438,452.04 | 1.42 |
| 7 | COMCAST CORP-CLASS A | 康卡斯特 | CMCSA US | 纳斯达克 | 美国 | 1,995 | 433,095.84 | 1.40 |
| 8 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | Verizon通信 | VZ US | 纽交所 | 美国 | 1,298 | 432,079.73 | 1.40 |
| 9 | DUKE ENERGY CORP | 杜克能源 | DUK US | 纽交所 | 美国 | 820 | 429,057.40 | 1.39 |
| 10 | PFIZER INC | 辉瑞制药 | PFE US | 纽交所 | 美国 | 1,771 | 425,128.99 | 1.38 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细,应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站(www.cxfund.com.cn)的半年度报告正文。

7.4.2 积极投资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益投资明细

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA US | 875,173.24 | 2.14 |
| 2 | EXELON CORP | EXC US | 775,816.64 | 1.90 |
| 3 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | VZ US | 726,083.07 | 1.78 |
| 4 | Charter Communications Inc | CHTR US | 622,991.75 | 1.52 |
| 5 | SIMON PROPERTY GROUP INC | SPG US | 601,823.66 | 1.47 |
| 6 | AT&T INC | T US | 597,987.81 | 1.46 |
| 7 | ALTRIA GROUP INC | MO US | 568,590.96 | 1.39 |
| 8 | TIME WARNER INC | TWX US | 502,007.59 | 1.23 |
| 9 | US BANCORP | USB US | 454,884.89 | 1.11 |
| 10 | KRAFT HEINZ CO/THE | KHC US | 443,262.87 | 1.08 |
| 11 | NEXTERA ENERGY INC | NEE US | 415,541.93 | 1.02 |
| 12 | FACEBOOK INC-A | FB US | 381,447.77 | 0.93 |
| 13 | WALGREEN BOOTS ALLIANCE | WBA US | 333,667.55 | 0.82 |
| 14 | FORD MOTOR CO | F US | 307,670.71 | 0.75 |
| 15 | NETFLIX INC | NFLX US | 307,501.46 | 0.75 |
| 16 | CVS CAREMARK CORP | CVS US | 286,420.73 | 0.70 |
| 17 | NVIDIA CORP | NVDA US | 276,731.48 | 0.68 |
| 18 | WELLS FARGO & CO | WFC US | 276,096.79 | 0.68 |
| 19 | 3M CO | MMM US | 261,023.78 | 0.64 |
| 20 | BOOKING HOLDINGS INC | BKNG US | 234,610.72 | 0.57 |

注:本项买入金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其它交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | EXELON CORP | EXC US | 1,244,540.76 | 3.05 |
| 2 | BOOKING HOLDINGS INC | BKNG US | 932,361.67 | 2.28 |
| 3 | FORD MOTOR CO | F US | 756,825.94 | 1.85 |
| 4 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA US | 705,435.94 | 1.73 |
| 5 | SIMON PROPERTY GROUP INC | SPG US | 701,087.50 | 1.72 |
| 6 | AT&T INC | T US | 693,060.32 | 1.70 |
| 7 | FACEBOOK INC-A | FB US | 676,775.07 | 1.66 |
| 8 | KINDER MORGAN INC | KMI US | 670,705.10 | 1.64 |
| 9 | KRAFT HEINZ CO/THE | KHC US | 646,233.90 | 1.58 |
| 10 | NEXTERA ENERGY INC | NEE US | 615,414.38 | 1.51 |
| 11 | BLK US | BLK US | 612,225.82 | 1.50 |
| 12 | DANAHER CORP | DHR US | 604,890.02 | 1.48 |
| 13 | US BANCORP | USB US | 597,708.50 | 1.46 |
| 14 | TIME WARNER INC | TWX US | 592,448.14 | 1.45 |
| 15 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | VZ US | 586,614.65 | 1.44 |
| 16 | ALTRIA GROUP INC | MO US | 547,037.05 | 1.34 |
| 17 | INTEL CORP | INTC US | 477,962.97 | 1.17 |
| 18 | Charter Communications Inc | CHTR US | 434,061.87 | 1.06 |
| 19 | CELGENE CORP | CELG US | 415,451.80 | 1.02 |
| 20 | MONSANTO CO | MON US | 336,839.58 | 0.82 |

注:本项卖出金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其它交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入成本(成交)总额 | 12,324,923.86 |
| 卖出收入(成交)总额 | 19,980,880.33 |

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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:本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.9 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:本基金本报告期末持有金融衍生品。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 23,859.06 |
| 4 | 应收利息 | 77.95 |
| 5 | 应收申购款 | 47,023.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 70,960.79 |

7.11.4 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债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名的股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五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进行积极投资。

7.11.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 2,917 | 8,622.64 | 10,001,888.88 | 39.77% | 15,150,344.64 | 60.23% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 5,930.03 | 0.02% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2011年3月30日)基金份额总额 | 508,424,713.40 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 33,035,414.29 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,978,821.79 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 11,862,002.56 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 25,152,233.52 |

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| Morgan Stanley & Co Intl Plc | - | 32,682,830.73 | 100.00% | 11,057.33 | 100.00% | - |

注:1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字【1998】29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字【2007】48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1)选择标准:

1)券商基本面评价(财务状况、经营状况);

2)券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量);

3)券商每日信息评价(及时性和有效性);

4)券商协作表现评价。

(2)选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 10,001,888.88 | 0.00 | 0.00 | 10,001,888.88 | 39.77% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 1、基金净值大幅波动的风险<br>单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回,可能会影响基金投资的持续性和稳定性,增加变现成本。同时,按照净值计算规范处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。<br>2、赎回申请延期办理的风险<br>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件,导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司
2018年8月29日