

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF））  
2015年第3季度报告

2015年9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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2015年10月26日

## § 1 重要提示

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事宜而来。基金管理人于2015年7月10日起至2015年7月16日期间召开长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，审议《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》，于2015年7月20日表决通过，决议自该日起生效，原《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》自该日起失效。

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月20日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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	长信中证中央企业100指数（LOF）
场内简称	长信100
基金主代码	163001

交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月26日
报告期末基金份额总额	206,772,718.31份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100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。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证中央企业100指数收益率*95%+银行同行业存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：上表中“报告期末”为2015年7月19日。

## 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	长信医疗保健混合（LOF）
场内简称	长信医疗
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月20日
报告期末基金份额总额	150,563,467.16份
投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，并精选医疗保健行业的优

	质企业进行投资，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	转型前
	报告期（2015年7月1日-2015年7月19日）
1. 本期已实现收益	6,834,969.39
2. 本期利润	-4,043,675.38
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2269
4. 期末基金资产净值	211,526,195.37
5. 期末基金份额净值	1.023

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。

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（2015年7月20日-2015年9月30日）
1. 本期已实现收益	-51,912,526.94
2. 本期利润	-39,220,611.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2238
4. 期末基金资产净值	121,647,730.23
5. 期末基金份额净值	0.808

注：1、本基金基金合同生效日为2015年7月20日，截至本报告期末，本基金运作未满一个季度；

2、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；

3、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（转型前）

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
（转型前）2015年7月1日至2015年7月19日	4.88%	3.06%	-7.81%	4.30%	12.69%	-1.24%

#### 3.2.2 自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



注：1、图示日期为2010年3月26日至2015年7月19日。

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，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。

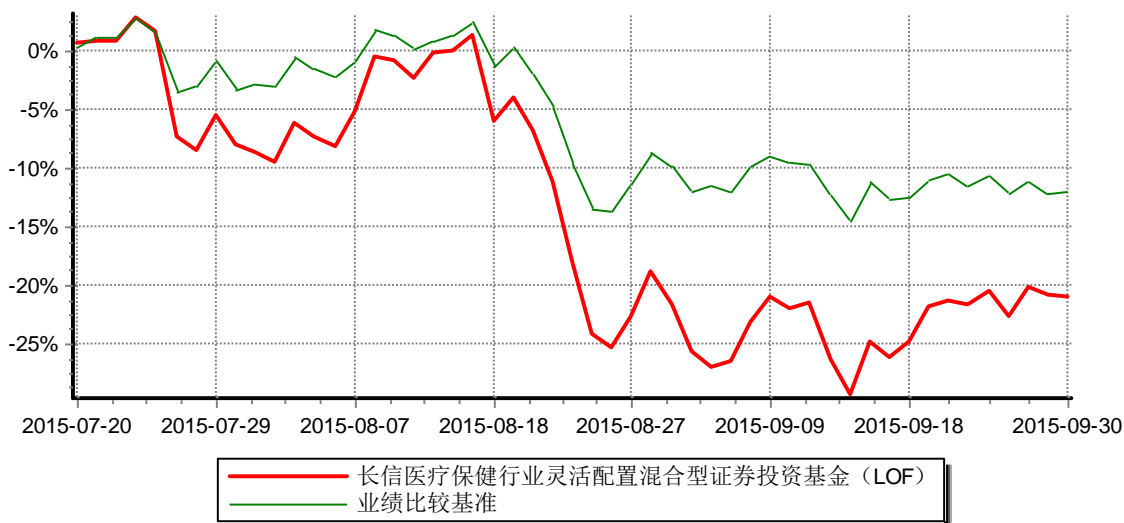
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
自基金合同生效之日起至今（2015年7月20日至2015年9月30日）	-21.02%	3.46%	-11.94%	2.02%	-9.08%	1.44%

注：转型后，本基金的业绩比较基准变更为：中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

#### 3.2.2 自基金转型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



注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年7月20日至2015年9月30日。

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，本基金的各项投资比例将符合基金合同中股票资产占基金资产的比例为0%–95%；投资于医疗保健行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券的约定。

截至报告期期末，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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	本基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小	2015年7月20日	—	4年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事

	<p>盘股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理</p>			<p>量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任本基金、长信量化先锋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、长信量化中小盘股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准（转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日）；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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来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

本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度市场出现较大调整。期间上证综指下跌28.63%，沪深300下跌28.39%，中证500下跌31.24%，中小板指下跌27.57%，创业板指下跌27.14%。就行业而言，申万一级行业全部下跌，其中银行、休闲服务、医药生物的跌幅相对较小，分别为17.97%、23.58%、25.34%，而钢铁、采掘、非银金融则成为了跌幅前三的行业，分别为39.52%、38.67%、37.92%。相较2015年上半年单边上涨市场行情，三季度市场快速大幅下挫，投资者情绪降至冰点。期间，本基金维持中低仓位，但在市场整体大幅下跌和超配小盘成长股的情况下，本基金净值遭遇较大回撤。

#### 4.4.2 2015年四季度市场展望和投资策略

本基金于2015年7月20日由长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)转型而来，变更为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。当前美联储加息预期不断弱化，股票和外汇市场情绪逐渐回归理性，市场流动性有望保持宽松。随着《关于推进分级诊疗制度建设的指导意见》、《关于做好进城落户农民参加基本医疗保险和关系转移接续工作的办法》等一系列利好政策的出台，在经历前期大幅下挫后，作为高成长板块的医药股变得更有吸引力，我们对于下季度医疗板块走势整体看好，将综合运用各种量化投资模型筛选具有可持续的高成长优质投资标的构建投资组合，以期获得较为理想的超额收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金单位净值为0.808元，累计单位净值1.348元。本报告期内转型前本基金净值增长率为4.88%，同期业绩比较基准涨幅为-7.81%；本报告期内转型后本基金净值增长率为-21.02%，同期业绩比较基准涨幅为-11.94%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告（转型前）

报告周期：2015年7月1日至2015年7月19日

#### 5.1 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	198,358,660.70	87.17
	其中：股票	198,358,660.70	87.17
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	24,670,944.13	10.84
8	其他资产	4,522,841.78	1.99
9	合计	227,552,446.61	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采矿业	12,983,303.09	6.14
C	制造业	44,725,118.69	21.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,539,292.41	4.04
E	建筑业	20,426,652.90	9.66
F	批发和零售业	579,990.69	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,083,732.46	1.93
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,714,083.74	2.23
J	金融业	78,611,091.94	37.16
K	房地产业	12,643,661.59	5.98
L	租赁和商务服务业	852,834.78	0.40
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,013,625.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	189,173,387.29	89.43

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	214,315.20	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	151,152.78	0.07
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	7,197,652.81	3.40
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	1,622,152.62	0.77
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
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	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	9,185,273.41	4.34

### 5.3 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

#### 5.3.1 报告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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	837,582	15,378,005.52	7.27
2	601988	中国银行	1,879,613	9,717,599.21	4.59
3	600030	中信证券	361,089	9,164,438.82	4.33
4	601766	中国中车	481,997	8,825,365.07	4.17
5	601328	交通银行	1,008,837	8,070,696.00	3.82
6	000002	万科A	497,667	7,499,841.69	3.55
7	601398	工商银行	1,217,472	6,343,029.12	3.00
8	601668	中国建筑	770,691	6,273,424.74	2.97
9	601818	光大银行	1,022,758	5,502,438.04	2.60
10	601288	农业银行	1,358,003	5,106,091.28	2.41

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	308,597	3,548,865.50	1.68
2	601919	中国远洋	265,602	2,294,801.28	1.08
3	601788	光大证券	69,234	1,622,152.62	0.77
4	601333	广深铁路	173,352	989,839.92	0.47
5	601872	招商轮船	47,851	364,146.11	0.17

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，中信证券（600030）的发行主体于2015年1月18日发布公告称因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此，公司已采取以下整改措施：1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。2、自2015年1月16日起，公司将不允许新增任何新的合约逾期，距合约到期前将反复提醒客户及时了结合约，对于到期未了结的合约将强制平仓。3、在监管规定的时间内，清理完成旧的逾期合约。4、

将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。

对该股票投资决策程序的说明：本基金采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100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。金融工程部根据上述投资策略将该股票纳入基金投资对象备选库并进行投资。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	139,442.36
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,196,718.29
5	应收申购款	3,186,681.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,522,841.78

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 5 投资组合报告（转型后）

报告周期：2015年7月20日至2015年9月30日

## 5.1 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	88,460,764.99	71.56
	其中：股票	88,460,764.99	71.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	34,644,294.35	28.03
8	其他资产	506,839.78	0.41
9	合计	123,611,899.12	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,151.33	—
C	制造业	77,896,856.28	64.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,689,690.57	1.40
E	建筑业	5,860.23	—
F	批发和零售业	2,297,234.14	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	790,171.64	0.65
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	625,017.92	0.51

J	金融业	22,829.42	0.02
K	房地产业	1,559.94	-
L	租赁和商务服务业	3,868.72	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,124,524.80	4.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	88,460,764.99	72.72

### 5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300318	博晖创新	172,700.00	3,179,407.00	2.61
2	300049	福瑞股份	106,500.00	2,961,765.00	2.43
3	300381	溢多利	78,400.00	2,371,600.00	1.95
4	300216	千山药机	65,600.00	2,174,640.00	1.79
5	002393	力生制药	62,200.00	2,040,160.00	1.68
6	002365	永安药业	137,600.00	2,008,960.00	1.65
7	300347	泰格医药	57,100.00	1,847,185.00	1.52
8	300009	安科生物	82,800.00	1,805,868.00	1.48
9	300244	迪安诊断	25,800.00	1,787,682.00	1.47
10	002349	精华制药	64,900.00	1,751,002.00	1.44

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细



本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	192,001.05
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	276,024.16
5	应收申购款	38,814.57
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	506,839.78
---	----	------------

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300216	千山药机	2,174,640.00	1.79	停牌

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	107,892,336.37
报告期期间基金总申购份额	6,764,626,107.61
减：报告期期间基金总赎回份额	6,721,954,976.82
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	150,563,467.16

注：转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日，当日基金份额总额为206,772,718.31份，基金合同生效日起至报告期期末（2015年7月20日至2015年9月30日）基金总申购份额为39,002,401.46份，基金合同生效日起至报告期期末（2015年7月20日至2015年9月30日）基金总赎回份额为95,211,652.61份，报告期期末基金份额总额为150,563,467.16份。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 备查文件目录

## 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 6、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 7、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 9、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

## 8.2 存放地点

基金管理人的住所。

## 8.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

二〇一五年十月二十六日