

# 长信利保债券型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 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

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 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.....	45
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权证投资明细.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信利保债券型证券投资基金
基金简称	长信利保债券
场内简称	长信利保
基金主代码	519947
交易代码	519947
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 16 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
报告期末基金份额总额	1,599,250,706.07 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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，开展战略资源配置，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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成基金的投资策略结构。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 行业配置策略；</p> <p>(2) 个股投资策略。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持类证券等金融工具的投资。</p>
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投

	资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。
--	------------------------

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	田青
	联系电话	021-61009999	010-67595096
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4007005566	010-67595096
传真		021-61009800	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		叶焯	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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 号时代金融中心 9 楼、北京西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-58,214,605.90
本期利润	-55,341,546.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0258
本期加权平均净值利润率	-2.68%
本期基金份额净值增长率	-2.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-52,082,732.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0326
期末基金资产净值	1,562,170,055.98
期末基金份额净值	0.9768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-2.32%

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。

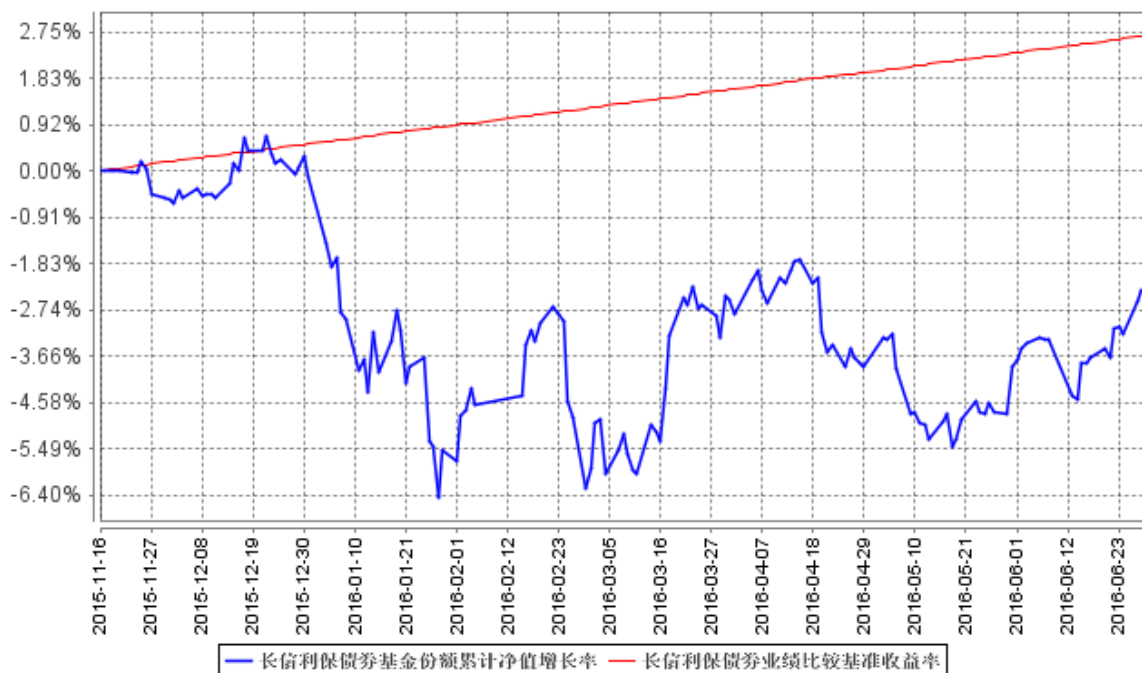
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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	1.62%	0.39%	0.35%	0.01%	1.27%	0.38%
过去三个月	0.23%	0.41%	1.07%	0.01%	-0.84%	0.40%
过去六个月	-2.22%	0.59%	2.11%	0.01%	-4.33%	0.58%
自基金合同生效起至今	-2.32%	0.53%	2.65%	0.01%	-4.97%	0.52%

### 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、本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 16 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。图示日期为 2015 年 11 月 16 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。



## § 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 1.5 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 49%、上海海欣集团股份有限公司占 34.33%、武汉钢铁股份有限公司占 16.67%。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 37 只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普 100 等权重指数 (QDII)、长信利鑫债券 (LOF)、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券 (LOF)、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合 (LOF)、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券、长信中证能源互联网指数 (LOF)、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券 (QDII)、长信先锐债券、长信利发债券。

#### 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		
李小羽	本基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利丰债券基金、长信利广混合基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、	2015 年 11 月 16 日	-	18 年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格 (CIM)。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司（筹备），先后任

	长信利盈混合基金和长信利发债券基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员				基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、固定收益部总监、总经理助理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员，本基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利丰债券基金、长信利广混合基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利盈混合基金和长信利发债券基金的基金经理。
刘波	本基金、长信利众债券基金 (LOF)、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理。	2015 年 11 月 16 日	-	9 年	经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011 年 2 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益货币基金的基金经理。现任本基金、长信利众债券基金 (LOF)、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；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、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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且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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年以来，全球经济继续维持弱复苏状态，美联储加息一次后受制于经济增长和通胀因素开始趋于谨慎，新兴市场货币和股市年初大幅下跌后逐渐企稳。6 月英国脱欧事件对全球金融市场冲击较大，全球风险偏好下降。2016 年上半年中国经济继续缓慢下行，一季度发放天量信贷后数据开始降温。大宗商品价格在一季度暴涨后开始回调，带动 CPI 小幅下行。

2016 年一季度利率债收益率缓慢上行，城投收益率持续走低，4 月份债券市场经历了一波较大的调整，主要是资金利率短期波动，经济数据短期显著走强以及信用风险集中爆发所致。5 月份，利空得到缓解：经济数据再度走弱，权威人士称经济 L 型，信贷社融不及预期；并且信用违约没有新增超预期的主体。之后债券收益率小幅下降，但整体买盘不踊跃。6 月份在英国脱欧事

件带动下，避险情绪上升，债券市场走出了一波较好的行情。

本基金上半年维持信用债配置，适度控制久期，精选个券，规避信用风险，加大了灵活操作的力度，以提高组合的安全性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9768 元，报告期基金份额净值增长率为-2.22%，成立以来的累计净值为 0.9768 元，本期业绩比较基准增长率为 2.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面来看，今年较去年出现了一些变化，随着外围市场不稳定导致政策预期波动较大，经济数据和金融市场都波动较大。大宗商品也开始逐渐走出几年的漫漫熊市，CPI 低位震荡，PPI 负值收窄。中央经济工作会议提出五大任务中去产能居首，过剩产能有序出清将加速，行业内破产清算、兼并重组加剧，产能过剩行业再融资难度加大，外部支持力度减弱，信用风险上升，需谨防踩雷，规避过剩产能主体发行的债券。未来一段时间是过剩债券到期的高峰期，下一个信用债的雷在哪里非常难判断，但经济继续探底，违约率上升毋庸置疑。货币政策方面今年将降准预期较大，但迟迟未有兑现，货币进一步宽松对实体边际效用减弱，反而容易推升资产泡沫，因此央行也较为谨慎。仍然维持利率债市场震荡，低等级债券承压的判断。

我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断。适度控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、股票交易部总监、量化投资部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所

所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	52,693,465.80	298,085,807.46
结算备付金		1,396,116.47	1,196,153.31
存出保证金		489,278.30	34,715.11
交易性金融资产	6.4.6.2	1,516,653,162.51	1,673,048,724.78
其中：股票投资		299,759,390.51	289,195,815.78
基金投资		-	-
债券投资		1,216,893,772.00	1,383,852,909.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	249,000,000.00
应收证券清算款		2,511,891.77	-
应收利息	6.4.6.5	23,101,864.60	42,757,956.67
应收股利		-	-
应收申购款		57,341,600.00	149,999,317.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		1,654,187,379.45	2,414,122,674.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		49,999,805.00	99,999,730.00
应付证券清算款		40,006,577.69	154,685,837.37
应付赎回款		29,151.68	1,506,045.21
应付管理人报酬		850,020.72	997,525.50
应付托管费		242,863.05	285,007.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	639,673.30	562,799.61

应交税费		65,560.00	-
应付利息		19,507.76	15,419.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	164,164.27	123,398.79
负债合计		92,017,323.47	258,175,763.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	1,599,250,706.07	2,158,068,382.30
未分配利润	6.4.6.10	-37,080,650.09	-2,121,471.22
所有者权益合计		1,562,170,055.98	2,155,946,911.08
负债和所有者权益总计		1,654,187,379.45	2,414,122,674.46

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9768 元，基金份额总额 1,599,250,706.07 份。

2、本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
<b>一、收入</b>			-42,061,050.13
1.利息收入			34,110,510.21
其中：存款利息收入	6.4.6.11		721,963.32
债券利息收入			33,214,483.75
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			174,063.14
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			-80,137,116.89
其中：股票投资收益	6.4.6.12		-54,526,738.13
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.6.13		-26,551,307.50
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.1		-
贵金属投资收益	6.4.6.14		-
衍生工具收益	6.4.6.15		-
股利收益	6.4.6.16		940,928.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17		2,873,059.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）			-



5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	1,092,497.51
<b>减：二、费用</b>		13,280,496.73
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	7,194,625.03
2. 托管费	6.4.9.2.2	2,055,607.16
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	-
4. 交易费用	6.4.6.19	2,576,299.33
5. 利息支出		1,270,576.84
其中：卖出回购金融资产支出		1,270,576.84
6. 其他费用	6.4.6.20	183,388.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-55,341,546.86
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-55,341,546.86

注：本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利保债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,158,068,382.30	-2,121,471.22	2,155,946,911.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-55,341,546.86	-55,341,546.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-558,817,676.23	20,382,367.99	-538,435,308.24
其中：1.基金申购款	955,928,976.91	-37,701,705.72	918,227,271.19
2. 基金赎回款	-1,514,746,653.14	58,084,073.71	-1,456,662,579.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益(基金净值)	1,599,250,706.07	-37,080,650.09	1,562,170,055.98
-----------------	------------------	----------------	------------------

注：本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>覃波</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信利保债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 9 月 29 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长信利保债券型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]221 号)准予注册，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利保债券型证券投资基金证券投资基金合同》发售，基金合同于 2015 年 11 月 16 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金为债券型基金，本基金采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各自市场上不同投资品种的具体分析，共同构成基金的投资策略结构。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金于 2015 年 10 月 22 日至 2015 年 11 月 11 日募集，募集资金总额人民币 305,021,095.31 元，利息转份额人民币 108,078.34 元，募集规模为 305,129,173.65 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1500956 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利保债券型证券投资基金基金合同》和《长信利保债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准：三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况、2016年1月1日至2016年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### -其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-金融所转移金融资产的账面价值

-结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参

数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息

债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信利保债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率逐日计提。

根据《长信利保债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”),若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明。**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期会计政策无变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期会计估计无变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期本基金无重大会计差错。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 本基金适用的主要税项**

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于

证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (6) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.6.2 应交税费

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应交债券利息收入所得税	65,560.00元

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	52,693,465.80



定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	52,693,465.80

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	294,333,691.32	299,759,390.51	5,425,699.19
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	70,524,772.00	-112,637.16
	银行间市场	1,146,369,000.00	-7,404,572.50
	合计	1,216,893,772.00	-7,517,209.66
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,518,744,672.98	1,516,653,162.51	-2,091,510.47

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,483.71
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	628.30
应收债券利息	23,094,532.39
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	220.20
合计	23,101,864.60

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	630,828.45
银行间市场应付交易费用	8,844.85
合计	639,673.30

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	65.79
预提信息披露费-上证报	49,726.04
预提信息披露费-中证报	39,781.56
预提信息披露费-证券时报	39,781.56
审计费	34,809.32
合计	164,164.27

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,158,068,382.30	2,158,068,382.30
本期申购	955,928,976.91	955,928,976.91
本期赎回(以“-”号填列)	-1,514,746,653.14	-1,514,746,653.14
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,599,250,706.07	1,599,250,706.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,449,687.26	-3,571,158.48	-2,121,471.22
本期利润	-58,214,605.90	2,873,059.04	-55,341,546.86
本期基金份额交易产生的变动数	4,682,186.10	15,700,181.89	20,382,367.99
其中：基金申购款	-17,049,739.78	-20,651,965.94	-37,701,705.72
基金赎回款	21,731,925.88	36,352,147.83	58,084,073.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-52,082,732.54	15,002,082.45	-37,080,650.09

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	659,566.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,248.28
其他	28,148.84
合计	721,963.32

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-54,526,738.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-54,526,738.13

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	864,943,495.78
减：卖出股票成本总额	919,470,233.91
买卖股票差价收入	-54,526,738.13

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.14 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-26,551,307.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-26,551,307.50

**6.4.7.15 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,195,466,440.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,198,573,971.39
减：应收利息总额	23,443,776.89
买卖债券差价收入	-26,551,307.50

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	940,928.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	940,928.74

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,873,059.04
——股票投资	4,319,003.25
——债券投资	-1,445,944.21
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,873,059.04

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,033,342.87
转换费收入	59,154.64
合计	1,092,497.51

注：本基金不低于赎回费总额的 25% 应归基金资产。

#### 6.4.7.22 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,567,914.89
银行间市场交易费用	8,384.44
合计	2,576,299.33

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	129,289.16
银行费用	14,789.89
帐户维护费	4,500.00
其他费用	-
合计	183,388.37

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

### 6.4.9.2 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	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
长信-策略 4 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-策略 6 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-优享 1 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-优享 2 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,194,625.03
其中：支付销售机构的客户维护费	363,265.77

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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0.70%的年费率计提，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×0.70%/当年天数

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,055,607.16

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年末 2015年12月31日	
	持有基金份额	持有的基金份额占基金总 份额的比例	持有基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
长信-策略4号资产管理计划	320,756,777.24	20.06%	377,670,803.47	17.50%
长信-策略6号资	172,120,530.21	10.76%	179,905,627.64	8.34%

产管理计划				
长信-优享1号资产管理计划	7,726,570.28	0.48%	7,726,570.28	0.36%
长信优享2号资产管理计划	41,652,608.56	2.60%	-	-

注：本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	52,693,465.80	659,566.20

注：1、本基金基金合同于2015年11月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2016年6月30日的相关余额为人民币1,396,116.47元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

期末未持有应认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002373	千方科技	2016年5月12日	临时停牌	14.94	2016年8月16日	16.43	803,112	13,734,209.84	11,998,493.28	-



300166	东方国信	2016年6月8日	临时停牌	27.47	-	-	369,000	9,137,183.75	10,136,430.00	-
600576	万家文化	2016年4月11日	临时停牌	22.35	-	-	298,100	5,236,850.00	6,662,535.00	-
300246	宝莱特	2016年6月29日	临时停牌	30.31	2016年7月1日	32.20	158,986	4,955,623.39	4,818,865.66	-
300353	东土科技	2016年6月23日	临时停牌	22.09	-	-	66,899	1,173,233.22	1,477,798.91	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,999,805.00 元，是以如下债券作为质押：

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150408	15 农发 08	2016 年 7 月 11 日	100.95	500,000	50,475,000.00
合计				500,000	50,475,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、量化投资部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	55,566,500.00	-
未评级	1,161,327,272.00	-
合计	1,216,893,772.00	-

注：根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。

BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的量化投资部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，

并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	52,693,465.80	-	-	-	-	52,693,465.80
结算备付金	1,396,116.47	-	-	-	-	1,396,116.47
存出保证金	489,278.30	-	-	-	-	489,278.30
交易性金融资产	49,995,000.00	229,355,500.00	922,585,000.00	14,958,272.00	299,759,390.51	1,516,653,162.51
应收证券清算款	-	-	-	-	2,511,891.77	2,511,891.77
应收利息	-	-	-	-	23,101,864.60	23,101,864.60
应收申购款	-	-	-	-	57,341,600.00	57,341,600.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	104,573,860.57	229,355,500.00	922,585,000.00	14,958,272.00	382,714,746.88	1,654,187,379.45
负债						
卖出回购金融资产款	49,999,805.00	-	-	-	-	49,999,805.00
应付证券清算款	-	-	-	-	40,006,577.69	40,006,577.69
应付赎回款	-	-	-	-	29,151.68	29,151.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	850,020.72	850,020.72
应付托管费	-	-	-	-	242,863.05	242,863.05
应付交易费用	-	-	-	-	639,673.30	639,673.30
应付利息	-	-	-	-	19,507.76	19,507.76
应交税费	-	-	-	-	65,560.00	65,560.00
其他负债	-	-	-	-	164,164.27	164,164.27
负债总计	49,999,805.00	-	-	-	42,017,518.47	92,017,323.47
利率敏感度缺口	54,574,055.57	229,355,500.00	922,585,000.00	14,958,272.00	340,697,228.41	1,562,170,055.98
上年度末 2015年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1年-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	298,085,807.46	-	-	-	-	298,085,807.46
结算备付金	1,196,153.31	-	-	-	-	1,196,153.31
存出保证金	34,715.11	-	-	-	-	34,715.11

交易性金融资产	258,821,759.00	-	1,125,031,150.00	-	289,195,815.78	1,673,048,724.78
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	-	150,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	42,757,956.67	42,757,956.67
应收申购款	149,999,000.00	-	-	-	317.13	149,999,317.13
其他资产	-	-	-	-	99,000,000.00	99,000,000.00
资产总计	858,137,434.88	-	1,125,031,150.00	-	430,954,089.58	2,414,122,674.46
负债						
卖出回购金融资产款	99,999,730.00	-	-	-	-	99,999,730.00
应付证券清算款	-	-	-	-	154,685,837.37	154,685,837.37
应付赎回款	-	-	-	-	1,506,045.21	1,506,045.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	997,525.50	997,525.50
应付托管费	-	-	-	-	285,007.30	285,007.30
应付交易费用	-	-	-	-	562,799.61	562,799.61
应付利息	-	-	-	-	15,419.60	15,419.60
其他负债	-	-	-	-	123,398.79	123,398.79
负债总计	99,999,730.00	-	-	-	158,176,033.38	258,175,763.38
利率敏感度缺口	758,137,704.88	-	1,125,031,150.00	-	272,778,056.20	2,155,946,911.08

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016年6月30日）	上年度末 （2015年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	104,711,113.66	4,175,239.17
市场利率上升 27 个基点	-104,711,113.66	-4,175,239.17	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券

以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 19.19%，债券投资比例为基金资产净值的 77.90%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	299,759,390.51	19.19	289,195,815.78	13.41
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,216,893,772.00	77.90	1,383,852,909.00	64.19
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,516,653,162.51	97.09	1,673,048,724.78	77.60

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	VaR 值为 1.16%		-18,121,172.65

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2015 年的分析同样基于该假设。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值计量的层次

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2016 年 6 月 30 日的账面

价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	35,094,122.85	264,665,267.66	—	299,759,390.51
债券投资		1,216,893,772.00	—	1,216,893,772.00
合计	35,094,122.85	1,481,559,039.66	—	1,516,653,162.51

2016年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

## 2、第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2016年上半年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

## § 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	299,759,390.51	18.12
	其中：股票	299,759,390.51	18.12
2	固定收益投资	1,216,893,772.00	73.56
	其中：债券	1,216,893,772.00	73.56
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	54,089,582.27	3.27
7	其他各项资产	83,444,634.67	5.04
8	合计	1,654,187,379.45	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	126,416,641.00	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,649,284.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	155,470,345.83	9.95



J	金融业	-	-
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	7,439,348.84	0.48
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	594,872.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	188,898.84	0.01
S	综合	-	-
	合计	299,759,390.51	19.19

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600728	佳都科技	1,251,544	12,165,007.68	0.78
2	600745	中茵股份	447,324	12,006,176.16	0.77
3	002373	千方科技	803,112	11,998,493.28	0.77
4	002402	和而泰	423,697	11,461,003.85	0.73
5	002230	科大讯飞	325,781	10,701,905.85	0.69
6	300166	东方国信	369,000	10,136,430.00	0.65
7	002439	启明星辰	391,557	10,113,917.31	0.65
8	300020	银江股份	526,104	9,785,534.40	0.63
9	002405	四维图新	375,745	9,243,327.00	0.59
10	300359	全通教育	311,255	9,231,823.30	0.59
11	300253	卫宁健康	355,995	8,793,076.50	0.56
12	002488	金固股份	386,360	8,121,287.20	0.52
13	300124	汇川技术	416,474	8,079,595.60	0.52
14	002410	广联达	553,506	7,915,135.80	0.51
15	000555	神州信息	235,100	7,614,889.00	0.49
16	600645	中源协和	211,706	7,439,348.84	0.48
17	300367	东方网力	299,513	7,436,907.79	0.48

18	300011	鼎汉技术	309,000	7,252,230.00	0.46
19	600576	万家文化	298,100	6,662,535.00	0.43
20	300007	汉威电子	234,277	6,541,013.84	0.42
21	002268	卫士通	178,879	6,393,135.46	0.41
22	300369	绿盟科技	148,302	6,274,657.62	0.40
23	002609	捷顺科技	351,420	6,181,477.80	0.40
24	300168	万达信息	208,700	5,424,113.00	0.35
25	002055	得润电子	175,654	5,378,525.48	0.34
26	600588	用友网络	273,700	5,359,046.00	0.34
27	300246	宝莱特	158,986	4,818,865.66	0.31
28	300088	长信科技	321,041	4,773,879.67	0.31
29	002308	威创股份	285,373	4,688,678.39	0.30
30	601877	正泰电器	228,600	4,309,110.00	0.28
31	002384	东山精密	211,600	4,202,376.00	0.27
32	600305	恒顺醋业	336,700	3,878,784.00	0.25
33	000997	新大陆	190,300	3,813,612.00	0.24
34	300171	东富龙	200,954	3,794,011.52	0.24
35	002189	利达光电	130,200	3,679,452.00	0.24
36	600410	华胜天成	308,062	3,456,455.64	0.22
37	300010	立思辰	149,768	3,142,132.64	0.20
38	600559	老白干酒	126,500	3,030,940.00	0.19
39	300131	英唐智控	252,900	2,986,749.00	0.19
40	600074	保千里	192,600	2,873,592.00	0.18
41	300170	汉得信息	174,600	2,650,428.00	0.17
42	300114	中航电测	83,252	2,480,909.60	0.16
43	300078	思创医惠	48,000	1,605,120.00	0.10
44	300228	富瑞特装	93,788	1,594,396.00	0.10
45	300053	欧比特	86,600	1,571,790.00	0.10
46	300358	楚天科技	80,000	1,550,400.00	0.10
47	603019	中科曙光	38,900	1,548,998.00	0.10
48	300353	东土科技	66,899	1,477,798.91	0.09
49	000050	深天马A	69,800	1,456,726.00	0.09
50	000559	万向钱潮	92,700	1,446,120.00	0.09
51	002284	亚太股份	75,200	1,435,568.00	0.09
52	002368	太极股份	38,984	1,385,101.52	0.09
53	300036	超图软件	51,000	1,249,500.00	0.08
54	300252	金信诺	35,841	1,187,412.33	0.08
55	600570	恒生电子	17,700	1,181,829.00	0.08
56	300248	新开普	32,381	871,372.71	0.06

57	600118	中国卫星	22,900	769,440.00	0.05
58	000988	华工科技	37,700	755,885.00	0.05
59	600552	凯盛科技	36,800	744,832.00	0.05
60	600661	新南洋	21,200	594,872.00	0.04
61	002030	达安基因	16,720	464,816.00	0.03
62	600718	东软集团	21,176	387,944.32	0.02
63	300291	华录百纳	8,028	188,898.84	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002625	龙生股份	36,804,932.78	1.71
2	000988	华工科技	36,224,379.09	1.68
3	000697	炼石有色	35,854,223.98	1.66
4	300024	机器人	33,485,826.06	1.55
5	300059	东方财富	21,978,469.32	1.02
6	002488	金固股份	21,601,480.82	1.00
7	600718	东软集团	20,798,802.05	0.96
8	600745	中茵股份	18,182,037.94	0.84
9	600728	佳都科技	17,506,252.71	0.81
10	000555	神州信息	17,303,075.43	0.80
11	002230	科大讯飞	17,206,793.58	0.80
12	002373	千方科技	15,686,404.48	0.73
13	002268	卫士通	15,288,469.99	0.71
14	002284	亚太股份	15,181,617.22	0.70
15	600588	用友网络	14,564,390.24	0.68
16	002308	威创股份	14,460,622.50	0.67
17	600895	张江高科	14,271,367.40	0.66
18	600172	黄河旋风	14,264,095.96	0.66
19	002030	达安基因	13,474,785.65	0.63
20	300168	万达信息	13,216,596.57	0.61

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。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000988	华工科技	40,767,291.91	1.89
2	002625	龙生股份	39,813,612.29	1.85
3	000697	炼石有色	36,813,773.87	1.71
4	300024	机器人	35,943,646.92	1.67
5	600895	张江高科	23,190,868.00	1.08
6	600410	华胜天成	21,377,781.96	0.99
7	300059	东方财富	21,258,294.06	0.99
8	000848	承德露露	18,765,508.21	0.87
9	600718	东软集团	18,731,194.12	0.87
10	600588	用友网络	17,106,396.94	0.79
11	300146	汤臣倍健	16,454,968.15	0.76
12	002284	亚太股份	15,630,399.47	0.72
13	002268	卫士通	15,280,938.00	0.71
14	300246	宝莱特	14,971,173.07	0.69
15	002273	水晶光电	14,605,647.62	0.68
16	002008	大族激光	14,316,496.52	0.66
17	600172	黄河旋风	14,178,665.07	0.66
18	002488	金固股份	14,056,277.88	0.65
19	002568	百润股份	13,928,364.56	0.65
20	300222	科大智能	13,775,643.93	0.64

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，不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	925,714,805.39
卖出股票收入（成交）总额	864,943,495.78

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	64,953,272.00	4.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,146,369,000.00	73.38
	其中：政策性金融债	1,146,369,000.00	73.38
4	企业债券	5,571,500.00	0.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,216,893,772.00	77.90

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150406	15 农发 06	2,000,000	203,200,000.00	13.01
2	150401	15 农发 01	1,800,000	183,006,000.00	11.71
3	140322	14 进出 22	1,400,000	142,772,000.00	9.14
4	150417	15 农发 17	1,200,000	121,044,000.00	7.75
5	150201	15 国开 01	1,000,000	101,610,000.00	6.50

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 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。**

**7.12.2 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。**

### 7.12.3 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	489,278.30
2	应收证券清算款	2,511,891.77
3	应收股利	-
4	应收利息	23,101,864.60
5	应收申购款	57,341,600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,444,634.67

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002373	千方科技	11,998,493.28	0.77	临时停牌
2	300166	东方国信	10,136,430.00	0.65	临时停牌

### 7.12.6 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。

## § 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
1,053	1,518,756.61	1,437,277,726.70	89.87%	161,972,979.37	10.13%

### 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	994.94	0.00%

### 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（2015年11月16日）基金份额总额	305,129,173.65
本报告期期初基金份额总额	2,158,068,382.30
本报告期基金总申购份额	955,928,976.91
减：本报告期基金总赎回份额	1,514,746,653.14
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	1,599,250,706.07



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

#### 10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 10.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期本基金未更换为基金审计的会计师事务所。

### 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

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
方正证券	1	970,420,341.82	54.19%	806,711.65	52.24%	-
兴业证券	1	264,751,472.00	14.79%	220,088.78	14.25%	-
光大证券	1	252,825,794.00	14.12%	235,456.31	15.25%	-
东北证券	1	168,471,607.14	9.41%	156,896.19	10.16%	-
招商证券	1	134,189,086.21	7.49%	124,970.50	8.09%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	142,256,833.79	68.65%	-	-	-	-
东北证券	14,961,040.00	7.22%	135,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	49,999,500.00	24.13%	-	-	-	-
中国国际金融 有限证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增方正证券 1 个交易单元。

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	长信基金管理有限责任公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016 年 1 月 8 日
3	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 1 日
4	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 4 月 7 日
5	长信利保债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 5 月 11 日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 6 月 16 日

8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
9	长信利保债券型证券投资基金更新的招募说明书（2016 年【1】号）及摘要	上证报、中证报、证券时报	2016 年 6 月 29 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利保债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利保债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利保债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、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。

### 11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 11.3 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  
2016年8月26日