

长信利丰债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59

§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利丰债券型证券投资基金	
基金简称	长信利丰债券	
基金主代码	519989	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 月 29 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,484,963,810.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
下属分级基金场内简称:	长信 LFC	-
下属分级基金的交易代码:	519989	004651
报告期末下属分级基金的份额总额	1,343,187,200.08 份	141,776,610.77 份

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严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的 20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。
业绩比较基准	中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	贺倩
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	200120	100031
法定代表人	成善栋	周慕冰

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、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 9 楼、北京市西城区 复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
C 类注册登记机构	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
E 类注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§ 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

基金级别	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
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)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,417,278.35	1,547,625.30
本期利润	4,650,586.10	4,816,006.04
加权平均基金份额本期利润	0.0029	0.0233
本期加权平均净值利润率	0.22%	1.73%
本期基金份额净值增长率	0.43%	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	94,023,207.20	45,576,313.42
期末可供分配基金份额利润	0.0700	0.3215
期末基金资产净值	1,788,843,556.97	188,979,337.11
期末基金份额净值	1.332	1.333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	109.85%	3.53%

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

长信利丰债券 C

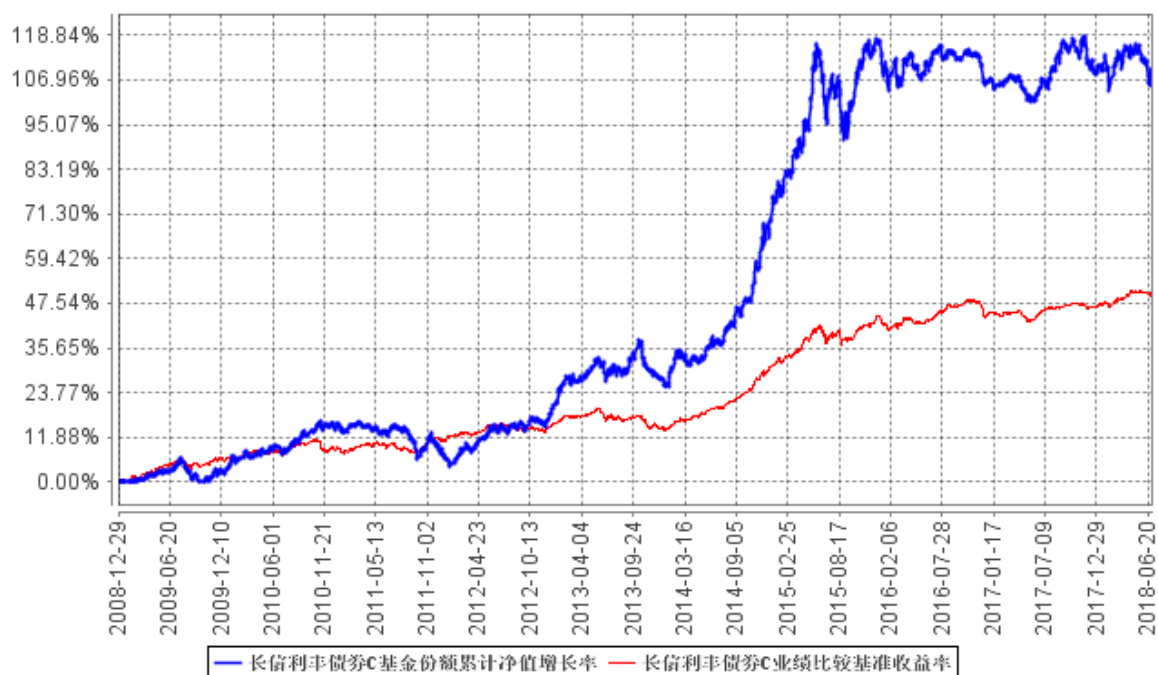
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.11%	0.59%	-0.22%	0.14%	-0.89%	0.45%
过去三个月	-2.35%	0.50%	0.78%	0.14%	-3.13%	0.36%
过去六个月	0.43%	0.50%	2.45%	0.13%	-2.02%	0.37%
过去一年	1.29%	0.46%	3.11%	0.11%	-1.82%	0.35%

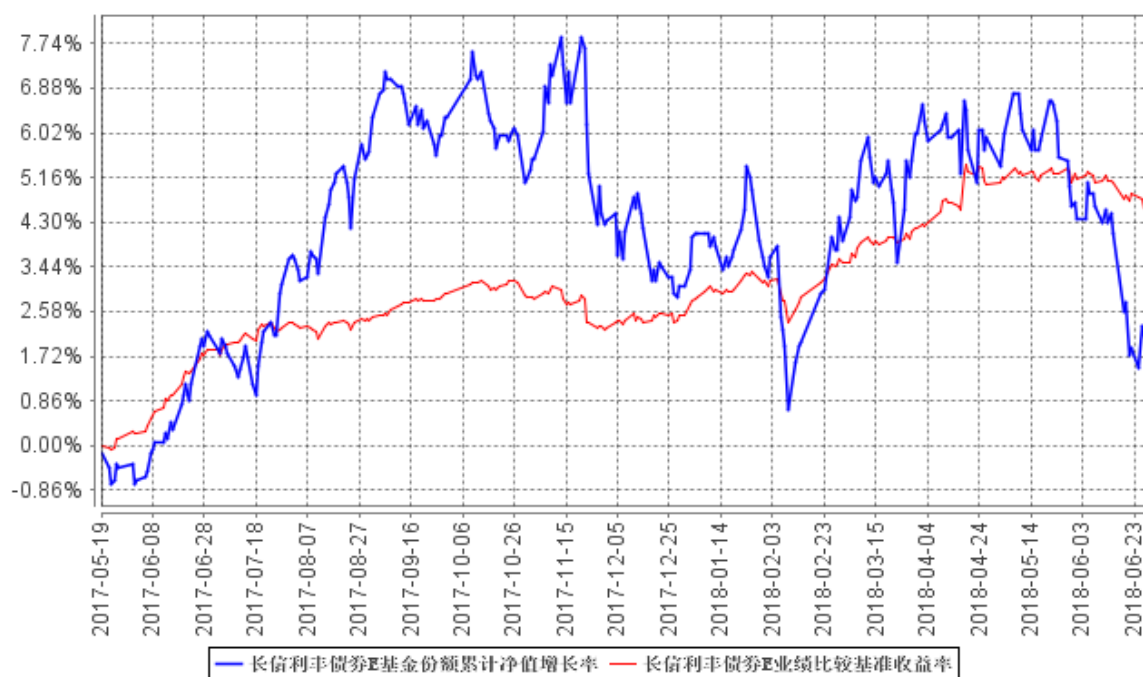
过去三年	3.53%	0.50%	7.91%	0.17%	-4.38%	0.33%
自基金合同生效起至今	109.85%	0.46%	50.24%	0.18%	59.61%	0.28%

长信利丰债券 E

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	-1.11%	0.59%	-0.22%	0.14%	-0.89%	0.45%
过去三个月	-2.34%	0.50%	0.78%	0.14%	-3.12%	0.36%
过去六个月	0.43%	0.50%	2.45%	0.13%	-2.02%	0.37%
过去一年	1.36%	0.46%	3.11%	0.11%	-1.75%	0.35%
自份额增加日起至今	3.53%	0.45%	5.02%	0.11%	-1.49%	0.34%

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、基金管理人自 2017 年 5 月 19 日起对长信利丰债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 C 类份额，增设 E 类份额。

2、长信利丰债券 C 图示日期为 2008 年 12 月 29 日至 2018 年 6 月 30 日，长信利丰债券 E 图示日期为 2017 年 5 月 19 日（份额增加日）至 2018 年 6 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

§ 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 1.65 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		
李小羽	长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放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、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资	2008 年 12 月 29 日	-	20 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 年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。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、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯

	基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员				债一年定期开放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、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
胡琼予	曾任本基金的基金经理助理	2016 年 12 月 12 日	2018 年 5 月 22 日	6 年	曾任本基金的基金经理助理
吴晖	长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理助理	2017 年 7 月 28 日	-	3 年	清华大学工学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行、东方证券股份有限公司，2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，现任职于固定收益部，担任长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理助理。

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

2018 年以来，国内外的宏观环境不确定性加剧，无论是权益还是固定收益市场，走势均呈现震荡分化。权益市场经历了年初的大幅波动后，先后出现了创业板、消费、医药和石化等板块的轮动上涨，各行业优质个股获得超额收益。债券市场，在流动性和货币逐步宽松的推动下，以利率债为代表的无风险收益大幅下行，并逐步扩散至部分高等级信用品种。

上半年以科技创新为代表的成长板块，在一系列政策利好催化下，连续快速上涨，我们踏准了上涨节奏，深入研究个股，选取细分行业龙头，通过价差交易，获得超额收益。随后，在判断整体震荡行情的前提下，对收益及时兑现，并且在避险板块进行等待。债券类资产，在国债利率出现见顶迹象之后，迅速介入利率债的交易行情，获得波段操作收益。并且判断趋势确立后，适当拉长久期和配置仓位。信用债方面，继续控制信用风险，优选高等级流动性好的品种，保证组合的稳健盈利。此外，本基金适当配置了部分低估值转债品种，以期在正股上涨和流动性拐点到来时，获得业绩和估值提升的双重收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，长信利丰债券 C 基金份额净值为 1.332 元，份额累计净值为 1.900 元，本报告期长信利丰债券 C 份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 2.45%；长信

利丰债券 E 基金份额净值为 1.333 元，份额累计净值为 1.408 元，本报告期长信利丰债券 E 份额净值增长率为 0.43%；同期业绩比较基准收益率为 2.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然今年宏观环境较为复杂，但是我们仍然看到国内经济的韧性和潜力。在近期一系列政策发布的信号作用下，表明对整体经济走势做好了提前的应对，无论是传统基建还是新兴的科技领域，都会继续拉动经济的平稳向好发展。目前，市场估值已经接近历史底部，监管政策也较此前有所缓和，市场有望企稳回升。经过上半年市场的震荡整理，前期一些高估值的个股已经回到合理估值，今年将获取真正业绩所带来的价值回报。关注半年报发布窗口，挖掘业绩超预期，在下跌中被错杀的品种，继续看好科技、医药、金融等板块的中长期机会。

在市场趋势弱化，波动加大情况下，需要我们加强研判，甄别个股，加强做好仓位和回撤控制。我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断，积极寻找权益资产的增强机会。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

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员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，均具备估值业务所需的专业胜任能力，基金经理不直接参与估值决策。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、《长信利丰债券型证券投资基金基

金合同》，结合本报告期基金实际运作情况，基金管理人于 2018 年 3 月 9 日发布《关于长信利丰债券型证券投资基金 2017 年年度分红公告》，收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日，权益登记日为 2018 年 3 月 13 日，现金红利发放日 2018 年 3 月 15 日。分红总额 17,639,700.95 元，其中现金分红 16,440,328.48 元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后各类基金份额每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益至少分配 1 次，最多分配 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 50%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的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；
- 8、法律法规或监管机构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合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：长信利丰债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.6.1	50,316,496.19	113,757,355.99
结算备付金		10,909,701.58	14,482,192.26
存出保证金		889,968.14	1,365,908.87
交易性金融资产	6.4.6.2	1,996,770,500.54	2,862,469,046.76
其中：股票投资		393,848,375.04	346,176,676.11
基金投资		-	-
债券投资		1,602,922,125.50	2,516,292,370.65
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	-	54,964,267.48
应收证券清算款		5,309,133.87	-
应收利息	6.4.6.5	29,646,584.26	61,976,804.19
应收股利		-	-
应收申购款		32,465.44	80,030.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		2,093,874,850.02	3,109,095,605.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,000,000.00	-
应付证券清算款		42,087,669.39	2,532,911.57
应付赎回款		277,830.60	5,417,882.24
应付管理人报酬		1,150,260.30	1,542,282.74
应付托管费		328,645.80	440,652.24
应付销售服务费		657,291.59	881,304.43
应付交易费用	6.4.6.7	603,295.04	1,689,582.46

应交税费		757,882.20	688,737.74
应付利息		-29,223.13	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	218,304.15	333,067.55
负债合计		116,051,955.94	13,526,420.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,484,963,810.85	2,316,688,179.57
未分配利润	6.4.6.10	492,859,083.23	778,881,005.25
所有者权益合计		1,977,822,894.08	3,095,569,184.82
负债和所有者权益总计		2,093,874,850.02	3,109,095,605.79

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长信利丰债券 C 基金份额净值 1.332 元，长信利丰债券 E 基金份额净值 1.333 元。基金份额总额 1,484,963,810.85 份，其中 长信利丰债券 C 份额 1,343,187,200.08 份，长信利丰债券 E 份额 141,776,610.77 份。

6.2 利润表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		33,439,699.90	31,240,356.41
1.利息收入		45,892,110.00	76,153,004.66
其中：存款利息收入	6.4.6.11	495,605.84	529,571.50
债券利息收入		45,383,616.59	75,623,433.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,887.57	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,564,362.67	-140,968,336.75
其中：股票投资收益	6.4.6.12	9,768,564.12	-106,167,149.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-19,811,854.40	-37,300,068.60
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
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	1,478,927.61	2,498,881.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-4,498,311.51	95,557,775.08

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	610,264.08	497,913.42
减：二、费用		23,973,107.76	33,133,221.43
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	8,429,004.57	10,459,723.19
2. 托管费	6.4.9.2.2	2,408,287.05	2,988,492.36
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	4,816,574.02	5,976,984.63
4. 交易费用	6.4.6.19	4,118,136.11	4,420,222.37
5. 利息支出		3,945,740.20	9,138,004.31
其中：卖出回购金融资产支出		3,945,740.20	9,138,004.31
6. 税金及附加		109,039.56	-
7. 其他费用	6.4.6.20	146,326.25	149,794.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,466,592.14	-1,892,865.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,466,592.14	-1,892,865.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利丰债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	2,316,688,179.57	778,881,005.25	3,095,569,184.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,466,592.14	9,466,592.14
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）	-831,724,368.72	-277,848,813.21	-1,109,573,181.93
其中：1. 基金申购款	978,431,370.32	344,318,040.28	1,322,749,410.60
2. 基金赎回款	-1,810,155,739.04	-622,166,853.49	-2,432,322,592.53
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）	-	-17,639,700.95	-17,639,700.95
五、期末所有者权益（基金净值）	1,484,963,810.85	492,859,083.23	1,977,822,894.08

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	2,537,876,810.89	980,814,177.15	3,518,690,988.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,892,865.02	-1,892,865.02
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）	-684,659,710.37	-257,523,389.84	-942,183,100.21
其中：1.基金申购款	758,485,794.67	291,017,570.78	1,049,503,365.45
2.基金赎回款	-1,443,145,505.04	-548,540,960.62	-1,991,686,465.66
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）	1,853,217,100.52	721,397,922.29	2,574,615,022.81

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>成善栋</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

长信利丰债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]1252 号文《关于核准长信利丰债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2008 年 12 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 819,356,829.46 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

2017 年 5 月 19 日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信利丰债券型证券投资基金基金份额归为 C 类份额，并增设 E 类份额。C 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；E 类基金份额的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%；投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的 20%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为：中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

6.4.5.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适

用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的 7% 计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的 3% 计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的 2% 计缴。

6.4.5.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.5.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	50,316,496.19
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	50,316,496.19

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	410,644,941.33	393,848,375.04	-16,796,566.29
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	459,885,039.50	428,651,725.50
	银行间市场	1,178,101,419.00	1,174,270,400.00
	合计	1,637,986,458.50	1,602,922,125.50
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—

合计	2,048,631,399.83	1,996,770,500.54	-51,860,899.29
----	------------------	------------------	----------------

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,370.00
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	4,909.30
应收债券利息	29,632,904.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,000.05
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	400.50
合计	29,646,584.26

注：其他为应收保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	580,090.01
银行间市场应付交易费用	23,205.03
合计	603,295.04

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	208.21
预提信息披露费—中证报	39,671.58
预提信息披露费—证券时报	139,671.58
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	29,752.78
合计	218,304.15

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信利丰债券 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,054,085,372.20	2,054,085,372.20
本期申购	978,390,234.67	978,390,234.67
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,689,288,406.79	-1,689,288,406.79
— 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	1,343,187,200.08	1,343,187,200.08

金额单位：人民币元

长信利丰债券 E		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	262,602,807.37	262,602,807.37
本期申购	41,135.65	41,135.65
本期赎回 (以“-”号填列)	-120,867,332.25	-120,867,332.25
— 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	141,776,610.77	141,776,610.77

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信利丰债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	145,838,603.50	544,477,200.51	690,315,804.01
本期利润	12,417,278.35	-7,766,692.25	4,650,586.10
本期基金份额交易产生的变动数	-49,076,408.74	-185,077,358.57	-234,153,767.31
其中：基金申购款	68,445,904.82	275,857,250.11	344,303,154.93
基金赎回款	-117,522,313.56	-460,934,608.68	-578,456,922.24
本期已分配利润	-15,156,265.91	-	-15,156,265.91
本期末	94,023,207.20	351,633,149.69	445,656,356.89

单位：人民币元

长信利丰债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	84,681,476.89	3,883,724.35	88,565,201.24
本期利润	1,547,625.30	3,268,380.74	4,816,006.04
本期基金份额交易产生的变动数	-38,169,353.73	-5,525,692.17	-43,695,045.90
其中：基金申购款	13,295.06	1,590.29	14,885.35
基金赎回款	-38,182,648.79	-5,527,282.46	-43,709,931.25
本期已分配利润	-2,483,435.04	-	-2,483,435.04
本期末	45,576,313.42	1,626,412.92	47,202,726.34

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	327,547.16
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	117,379.57
其他	50,679.11
合计	495,605.84

注：其他为结算保证金利息收入、存出保证金利息收入及申购款利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益**6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,407,009,210.41
减：卖出股票成本总额	1,397,240,646.29
买卖股票差价收入	9,768,564.12

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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	-19,811,854.40
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	-19,811,854.40

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,745,717,989.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,649,127,406.57
减：应收利息总额	116,402,437.20
买卖债券差价收入	-19,811,854.40

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,478,927.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,478,927.61

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,498,311.51
——股票投资	-15,582,886.62
——债券投资	11,084,575.11
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,498,311.51

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	541,418.72
转换费收入	68,845.36
合计	610,264.08

注：本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中，对持续持有期少于 7 日的

投资者收取的赎回费全额计入基金财产；除此之外，赎回费总额的 25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,083,371.11
银行间市场交易费用	34,765.00
合计	4,118,136.11

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	79,343.16
帐户维护费	18,030.00
其他费用	19,200.31
合计	146,326.25

注：其他费用为银行手续费。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

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。

6.4.8.2 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、E 类份额注册登记机构、基金销

	售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	1, 228, 477, 016. 32	42. 84%	1, 260, 246, 419. 75	42. 27%

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的比例
长江证券	101, 851, 655. 46	22. 25%	-	-

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长江证券	60, 000, 000. 00	0. 42%	786, 700, 000. 00	18. 34%

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
长江证券	1,021,232.46	42.24%	20,174.53	3.48%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	1,047,642.74	41.37%	837,652.54	59.47%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 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	8,429,004.57	10,459,723.19
其中：支付销售机构的客户维护费	319,539.01	599,742.54

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 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

6.4.9.2.2 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	2,408,287.05	2,988,492.36

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	合计

长信基金管理有限责任公司	3,680,175.29	555,670.35	4,235,845.64
中国农业银行	21,977.93	0.00	21,977.93
长江证券	1,452.22	0.00	1,452.22
合计	3,703,605.44	555,670.35	4,259,275.79
获得销售服务费的 各关联方名称	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销售服务费		
	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E	合计
长信基金管理有限责任公司	4,821,625.76	0.23	4,821,625.99
中国农业银行	37,945.38	-	37,945.38
长江证券	1,504.85	-	1,504.85
合计	4,861,075.99	0.23	4,861,076.22

注：支付各关联方的销售服务费按前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		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
中国农业银行	50,316,496.19	327,547.16	34,419,006.71	453,713.99

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于 2018 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况**长信利丰债券 C**

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2018 年 3 月 13 日	2018 年 3 月 13 日	0.100	13,956,893.44	1,199,372.47	15,156,265.91	
合计	-	-	0.100	13,956,893.44	1,199,372.47	15,156,265.91	

长信利丰债券 E

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2018 年 3 月 13 日	2018 年 3 月 13 日	0.100	2,483,435.04	-	2,483,435.04	
合计	-	-	0.100	2,483,435.04	-	2,483,435.04	

6.4.11 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 70,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.12.2 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，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行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	800,262,000.00	719,137,000.00
合计	800,262,000.00	719,137,000.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级资产支持证券。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	19,736,000.00
合计	-	19,736,000.00

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+ 及以上评级。

6.4.12.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	379,802,481.20	372,866,699.70
AAA 以下	359,935,644.30	1,057,221,670.95
未评级	62,922,000.00	347,331,000.00
合计	802,660,125.50	1,777,419,370.65

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级资产支持证券。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级同业存单。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	50,316,496.19	-	-	-	-	50,316,496.19
结算备付金	10,909,701.58	-	-	-	-	10,909,701.58
存出保证金	889,968.14	-	-	-	-	889,968.14
交易性金融资产	585,136,772.80	515,513,205.20	439,350,147.50	62,922,000.00	393,848,375.04	1,996,770,500.54
应收证券清算款	-	-	-	-	5,309,133.87	5,309,133.87
应收利息	-	-	-	-	29,646,584.26	29,646,584.26
应收申购款	-	-	-	-	32,465.44	32,465.44
资产总计	647,252,938.71	515,513,205.20	439,350,147.50	62,922,000.00	428,836,558.61	2,093,874,850.02
负债						
卖出回购金融资产款	70,000,000.00	-	-	-	-	70,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	42,087,669.39	42,087,669.39
应付赎回款	-	-	-	-	277,830.60	277,830.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,150,260.30	1,150,260.30
应付托管费	-	-	-	-	328,645.80	328,645.80
应付销售服务费	-	-	-	-	657,291.59	657,291.59
应付交易费用	-	-	-	-	603,295.04	603,295.04
应付利息	-	-	-	-	-29,223.13	-29,223.13
应交税费	-	-	-	-	757,882.20	757,882.20
其他负债	-	-	-	-	218,304.15	218,304.15
负债总计	70,000,000.00	-	-	-	46,051,955.94	116,051,955.94
利率敏感度缺口	577,252,938.71	515,513,205.20	439,350,147.50	62,922,000.00	382,784,602.67	1,977,822,894.08
上年度末 2017 年 12 月 31 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	113,757,355.99	-	-	-	-	113,757,355.99
结算备付金	14,482,192.26	-	-	-	-	14,482,192.26
存出保证金	1,365,908.87	-	-	-	-	1,365,908.87
交易性金融资	1,333,204,442.15	154,540,574.00	980,772,354.50	47,775,000.00	346,176,676.11	2,862,469,046.76

产						
买入返售金融资产	54,964,267.48	-	-	-	-	54,964,267.48
应收利息	-	-	-	-	61,976,804.19	61,976,804.19
应收申购款	-	-	-	-	80,030.24	80,030.24
资产总计	1,517,774,166.75	154,540,574.00	980,772,354.50	47,775,000.00	408,233,510.54	3,109,095,605.79
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,532,911.57	2,532,911.57
应付赎回款	-	-	-	-	5,417,882.24	5,417,882.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,542,282.74	1,542,282.74
应付托管费	-	-	-	-	440,652.24	440,652.24
应付销售服务费	-	-	-	-	881,304.43	881,304.43
应付交易费用	-	-	-	-	1,689,582.46	1,689,582.46
应交税费	-	-	-	-	688,737.74	688,737.74
其他负债	-	-	-	-	333,067.55	333,067.55
负债总计	-	-	-	-	13,526,420.97	13,526,420.97
利率敏感度缺口	1,517,774,166.75	154,540,574.00	980,772,354.50	47,775,000.00	394,707,089.57	3,095,569,184.82

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	7,919,369.52	10,912,687.83
	市场利率上升 27 个基点	-7,919,369.52	-10,912,687.83

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的重大其他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) 等指标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 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	393,848,375.04	19.91	346,176,676.11	11.18
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,602,922,125.50	81.04	2,516,292,370.65	81.29
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	1,996,770,500.54	100.96	2,862,469,046.76	92.47

6.4.12.4.3.2 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 1.05%（2017 年 12 月 31 日 VaR 值为 0.45%）	-20,713,814.02	-14,043,447.60

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。2017 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值

6.4.13.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余

期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.13.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 648,867,465.04 元，属于第二层次的余额为人民币 1,347,903,035.50 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.13.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	393,848,375.04	18.81
	其中：股票	393,848,375.04	18.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,602,922,125.50	76.55
	其中：债券	1,602,922,125.50	76.55
	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	61,226,197.77	2.92
8	其他各项资产	35,878,151.71	1.71
9	合计	2,093,874,850.02	100.00

注：本基金本报告期末通过港股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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	188,574,945.76	9.53
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	-	-
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	195,331,429.28	9.88
J	金融业	9,942,000.00	0.50
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	393,848,375.04	19.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股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	002410	广联达	1,822,689	50,543,165.97	2.56
2	300166	东方国信	2,159,879	31,815,017.67	1.61
3	300373	扬杰科技	1,001,625	28,646,475.00	1.45
4	002049	紫光国微	569,854	25,141,958.48	1.27
5	000977	浪潮信息	900,000	21,465,000.00	1.09
6	300212	易华录	795,927	18,823,673.55	0.95
7	300348	长亮科技	670,722	18,625,949.94	0.94
8	603986	兆易创新	159,880	17,350,177.60	0.88
9	300474	景嘉微	360,000	16,732,800.00	0.85
10	603019	中科曙光	300,000	13,761,000.00	0.70
11	000063	中兴通讯	1,000,000	13,030,000.00	0.66
12	600588	用友网络	499,919	12,253,014.69	0.62
13	002405	四维图新	600,000	12,150,000.00	0.61
14	300047	天源迪科	674,500	10,522,200.00	0.53
15	600030	中信证券	600,000	9,942,000.00	0.50
16	002920	德赛西威	308,714	9,230,548.60	0.47
17	002065	东华软件	950,000	8,170,000.00	0.41
18	300353	东土科技	625,300	7,997,587.00	0.40
19	300383	光环新网	500,000	6,705,000.00	0.34
20	300316	晶盛机电	499,955	6,644,401.95	0.34
21	300532	今天国际	369,800	6,460,406.00	0.33
22	600570	恒生电子	100,000	5,295,000.00	0.27
23	600867	通化东宝	185,329	4,442,336.13	0.22

24	300226	上海钢联	70,000	4,189,500.00	0.21
25	600967	内蒙一机	300,000	3,822,000.00	0.19
26	300661	圣邦股份	29,900	3,682,185.00	0.19
27	002916	深南电路	50,000	3,175,500.00	0.16
28	300377	赢时胜	230,000	3,125,700.00	0.16
29	002023	海特高新	200,000	2,508,000.00	0.13
30	600498	烽火通信	100,000	2,485,000.00	0.13
31	300036	超图软件	120,000	2,446,800.00	0.12
32	002281	光迅科技	100,000	2,120,000.00	0.11
33	300253	卫宁健康	165,214	2,047,001.46	0.10
34	600702	舍得酒业	50,000	1,804,500.00	0.09
35	000066	中国长城	250,000	1,777,500.00	0.09
36	300558	贝达药业	30,000	1,670,100.00	0.08
37	300170	汉得信息	100,000	1,624,000.00	0.08
38	002371	北方华创	20,000	993,400.00	0.05
39	300369	绿盟科技	50,000	535,000.00	0.03
40	603609	禾丰牧业	10,000	94,400.00	0.00
41	000858	五粮液	1	76.00	0.00

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	000063	中兴通讯	84,307,105.94	2.72
2	603986	兆易创新	66,565,175.80	2.15
3	002049	紫光国微	56,056,322.53	1.81
4	300348	长亮科技	52,741,801.78	1.70
5	603019	中科曙光	50,414,722.55	1.63
6	601688	华泰证券	50,009,721.52	1.62
7	300166	东方国信	48,529,193.20	1.57
8	600588	用友网络	40,002,061.58	1.29
9	000069	华侨城 A	39,826,820.32	1.29
10	600030	中信证券	37,803,541.68	1.22
11	002405	四维图新	36,830,012.80	1.19
12	600048	保利地产	33,514,099.26	1.08
13	300212	易华录	31,346,626.07	1.01

14	002920	德赛西威	30,366,527.55	0.98
15	300253	卫宁健康	30,021,674.84	0.97
16	600340	华夏幸福	28,991,319.00	0.94
17	000001	平安银行	28,965,503.73	0.94
18	601877	正泰电器	24,842,754.12	0.80
19	601601	中国太保	24,365,066.36	0.79
20	300373	扬杰科技	23,889,121.22	0.77

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	603019	中科曙光	99,010,979.10	3.20
2	000063	中兴通讯	97,554,494.22	3.15
3	000100	TCL 集团	62,242,619.28	2.01
4	603986	兆易创新	58,714,563.48	1.90
5	300348	长亮科技	50,071,870.33	1.62
6	002405	四维图新	45,931,085.04	1.48
7	601688	华泰证券	45,271,210.97	1.46
8	601877	正泰电器	43,975,772.24	1.42
9	300253	卫宁健康	41,540,889.74	1.34
10	600588	用友网络	35,010,671.83	1.13
11	002049	紫光国微	34,253,948.25	1.11
12	000069	华侨城 A	34,217,749.40	1.11
13	000636	风华高科	33,787,153.50	1.09
14	600048	保利地产	33,204,117.18	1.07
15	600340	华夏幸福	31,049,435.71	1.00
16	601601	中国太保	28,180,117.67	0.91
17	000001	平安银行	26,229,614.40	0.85
18	600030	中信证券	24,058,836.00	0.78
19	002371	北方华创	23,606,315.82	0.76
20	600036	招商银行	22,359,608.40	0.72

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。

7.4.3 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	1,460,495,231.84
卖出股票收入（成交）总额	1,407,009,210.41

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	863,184,000.00	43.64
	其中：政策性金融债	863,184,000.00	43.64
4	企业债券	359,935,644.30	18.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	379,802,481.20	19.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,602,922,125.50	81.04

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	170410	17 农发 10	3,000,000	300,090,000.00	15.17
2	113011	光大转债	1,576,490	159,982,205.20	8.09
3	180404	18 农发 04	1,500,000	150,450,000.00	7.61
4	132009	17 石油 EB	1,281,670	124,783,391.20	6.31
5	170413	17 农发 13	1,000,000	100,230,000.00	5.07

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

注：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

注：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

注：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国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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	889,968.14
2	应收证券清算款	5,309,133.87
3	应收股利	-
4	应收利息	29,646,584.26
5	应收申购款	32,465.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,878,151.71

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	159,982,205.20	8.09
2	113013	国君转债	95,036,884.80	4.81

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

份额 级别	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
长信 利丰 债券 C	10,971	122,430.70	1,148,519,162.26	85.51%	194,668,037.82	14.49%
长信 利丰 债券 E	15	9,451,774.05	141,644,835.60	99.91%	131,775.17	0.09%
合计	10,986	135,168.74	1,290,163,997.86	86.88%	194,799,812.99	13.12%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长信利丰债券 C	30,259.09	0.00%
	长信利丰债券 E	-	-
	合计	30,259.09	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	份额级别	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	长信利丰债券 C	0~10
	长信利丰债券 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	长信利丰债券 C	0~10
	长信利丰债券 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利丰债券 C	长信利丰债券 E
基金合同生效日（2008 年 12 月 29 日）基金份额总额	819,356,829.46	—
本报告期期初基金份额总额	2,054,085,372.20	262,602,807.37
本报告期基金总申购份额	978,390,234.67	41,135.65
减：本报告期基金总赎回份额	1,689,288,406.79	120,867,332.25
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	1,343,187,200.08	141,776,610.77

§ 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

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	
长江证券	1	1,228,477,016.32	42.84%	1,021,232.46	42.24%	—
西南证券	1	380,008,766.82	13.25%	315,901.64	13.07%	—
太平洋证券	1	326,403,817.83	11.38%	238,699.25	9.87%	—
中金公司	1	309,917,161.49	10.81%	288,624.01	11.94%	—

中信建投	1	155,641,036.20	5.43%	144,948.12	6.00%	-
安信证券	1	140,191,506.22	4.89%	116,541.59	4.82%	-
华泰证券	2	127,351,902.13	4.44%	105,868.23	4.38%	-
银河证券	1	107,015,677.93	3.73%	99,663.45	4.12%	-
中邮证券	1	92,497,557.31	3.23%	86,143.39	3.56%	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券(已退租)	2	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	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
长江证券	101,851,655.46	22.34%	60,000,000.00	0.42%	-	-
西南证券	115,668,828.08	25.37%	6,420,000,000.00	44.86%	-	-
太平洋证券	51,169,534.77	11.22%	3,170,000,000.00	22.15%	-	-
中金公司	174,082,831.20	38.17%	3,250,000,000.00	22.71%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	12,000,000.00	0.08%	-	-
银河证券	13,085,894.80	2.87%	-	-	-	-

中邮证券	158,497.80	0.03%	1,400,000,000.00	9.78%	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券 (已退租)	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

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租用信达证券交易单元 1 个，退租广发证券交易单元 1 个。

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旗下基金 2017 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 1 月 4 日
3	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 1 月 5 日
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 1 月 16 日
5	长信利丰债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 1 月 20 日
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 2 月 1 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长量基金销售投资顾问有限公司开通转换、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、公司网站	2018 年 2 月 2 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 2 月 6 日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 2 月 7 日
10	长信利丰债券型证券投资基金更新的招募说明书（2018 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 2 月 10 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 2 月 10 日
12	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金 2017 年年度分红公告	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 3 月 9 日
13	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 3 月 9 日
14	长信基金管理有限责任公司关于长信利丰债券型证券投资基金恢复大额申购（含	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 3 月 13 日

	转换转入、定期定额投资)业务的公告		
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下 53 只基金修改基金合同、托管协议的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 3 月 24 日
16	长信利丰债券型证券投资基金基金合同 (流动性新规修改)	公司网站	2018 年 3 月 24 日
17	长信利丰债券型证券投资基金托管协议 (流动性新规修改)	公司网站	2018 年 3 月 24 日
18	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手机银行基金申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 3 月 29 日
19	长信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资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、公司网 站	2018 年 3 月 29 日
20	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中国工商银行股份有限公司个人电子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、公司网 站	2018 年 3 月 30 日
21	长信利丰债券型证券投资基金 2017 年年度报告及摘要(仅摘要见报)	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 3 月 31 日
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 4 月 18 日
23	长信利丰债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中证报、证券时报、 公司网站	2018 年 4 月 20 日
24	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 4 月 21 日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换业务及参加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、公司网站	2018 年 5 月 7 日
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 5 月 8 日
27	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中国银河证券股份有限公司基金申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2018 年 5 月 17 日
28	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开	上证报、中证报、 证券时报、证券日	2018 年 5 月 28 日

	放式证券投资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	报、公司网站	
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 5 月 31 日
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 7 日
31	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 15 日
32	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 20 日
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 22 日
34	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 28 日
35	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手机银行基金申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动及网上银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2018 年 6 月 30 日
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 6 月 30 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 6 月 30 日

§ 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 1 月 30 日； 2018 年 2 月 12 日至 2018 年 6 月 30 日	883,765,364.94	261,922,364.42	647,295,634.82	498,392,094.54	33.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 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，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。 2、赎回申请延期办理的风险 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。 3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。							

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利丰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。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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

2018 年 8 月 29 日