

# 长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 长信利尚一年定开混合       |
| 基金主代码      | 004607           |
| 交易代码       | 004607           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2017 年 11 月 17 日 |
| 基金管理人      | 长信基金管理有限责任公司     |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 34,810,776.91 份  |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，在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   | 在大类资产配置上，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，之后通过密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，动态调整各大类资产之间的比例，在有效控制基金下行风险的前提下，力争将本基金最大回撤率控制在 5% 以内。 |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。  |

### 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         | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 周永刚                  | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-61009999         | 010-66105798        |
|         | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4007005566           | 95588               |
| 传真      |      | 021-61009800         | 010-66105799        |

### 2.4 信息披露方式

|                    |                   |
|--------------------|-------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网 | www.cxfund.com.cn |
|--------------------|-------------------|

|            |  |
|------------|--|
| 址          |  |
| 基金年度报告备置地点 | 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 55 号 |

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2018 年        | 2017 年 11 月 17 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|--|
| 本期已实现收益       | 136,118.01    | 437,877.80                                 |
| 本期利润          | 580,554.56    | 429,761.09                                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0032        | 0.0021                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.96%         | 0.21%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末       | 2017 年末                                    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0117        | 0.0021                                     |
| 期末基金资产净值      | 35,216,623.07 | 200,567,395.90                             |
| 期末基金份额净值      | 1.0117        | 1.0021                                     |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

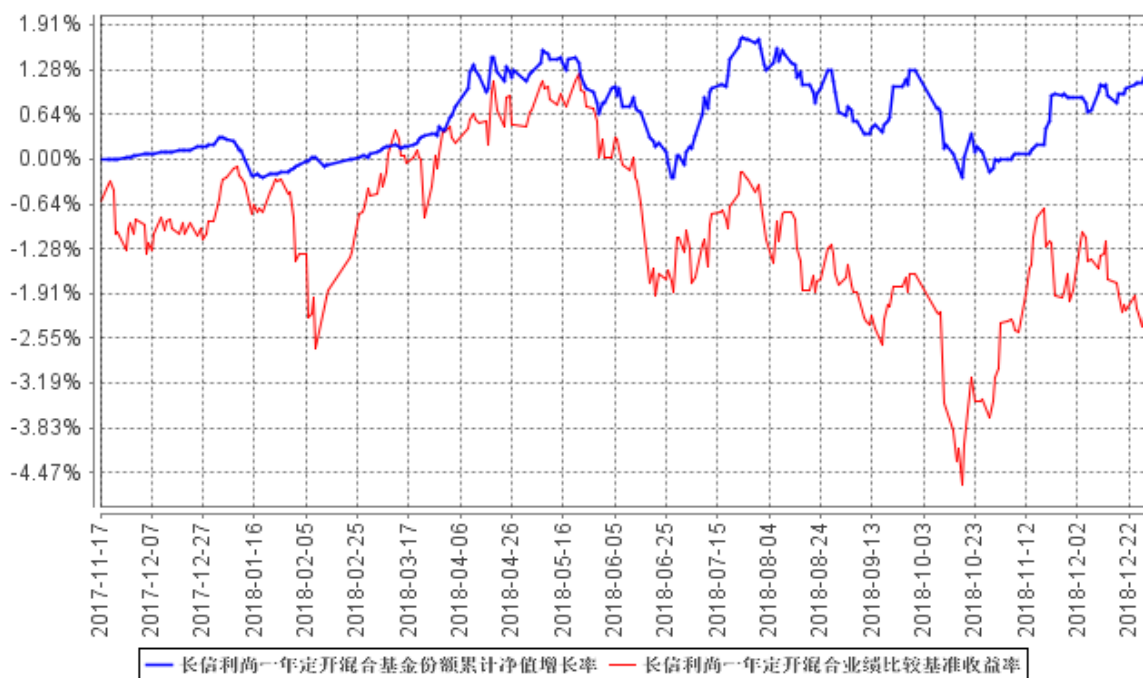
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | -0.10%   | 0.15%       | -0.62%     | 0.36%         | 0.52% | -0.21% |
| 过去六个月      | 1.13%    | 0.15%       | -1.15%     | 0.31%         | 2.28% | -0.16% |
| 过去一年       | 0.96%    | 0.13%       | -1.38%     | 0.30%         | 2.34% | -0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.17%    | 0.12%       | -2.26%     | 0.29%         | 3.43% | -0.17% |

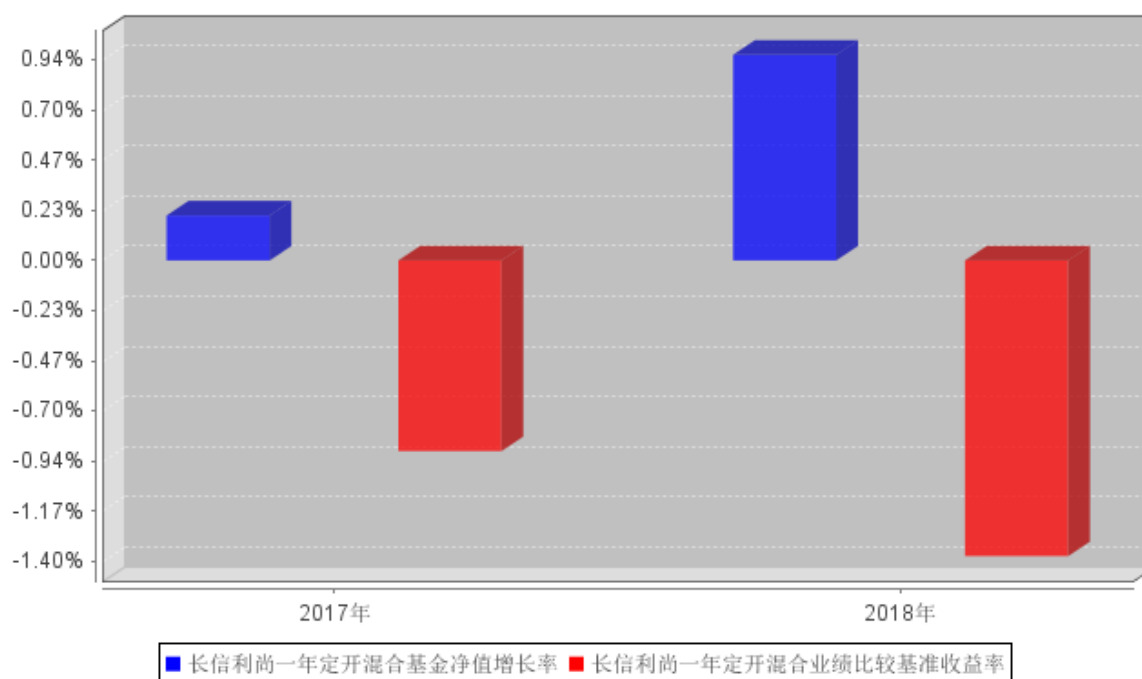
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2017 年 11 月 17 日至 2018 年 12 月 31 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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 17 日，2017 年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 17 日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 64 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、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）。

#### 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）<br>期限 |                 | 证券从<br>业年限 | 说明  |
|-----|--|---------------------|-----------------|------------|---|
|     |  | 任职日期                | 离任日期            |            |   |
| 李小羽 | 曾任本基金的<br>基金经理   | 2017年11月<br>17日     | 2018年12月<br>29日 | 20年        | 曾任本基金的基金经理  |
| 王夏儒 | 长信利尚一年<br>定期开放混合<br>型证券投资基<br>金、长信利保<br>债券型证券投<br>资基金、长信<br>利富债券型证<br>券投资基金和<br>长信利盈灵活<br>配置混合型证<br>券投资基金的<br>基金经理 | 2018年5月10<br>日      | -               | 8年         | 上海财经大学管理学硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券股份有限公司、华富基金管理有限责任公司、华创证券有限责任公司。2017年加入长信基金管理有限责任公司，曾任职于固收专户投资部，现任职于混合债券部并担任长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

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；

3、报告截止日至报告批准送出日期间，自2019年1月29日起，秦娟女士开始担任本基金的

基金经理；

4、报告截止日至报告批准送出日期间，自 2019 年 2 月 27 日起，王夏儒先生不再担任本基金的基金经理。

## 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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5：1 或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门

根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准,数量不符的,应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象,公司在获配额度确定后,严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的,应启动异常交易识别流程,审核通过的,可以进行相应分配。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。同时,对本年度同向交易价差进行专项分析,未发现异常情况。

## 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,全球经济增长动能减少,主要经济体经济走势出现分化。美国受税改因素提振因素,经济保持强劲势头,而非美经济整体放缓。反映到资产价格上,美元相对强势,美股和原油波动较大,而其它国家,尤其新兴市场的股市、汇率等都较为疲弱。

国内经济增速下行,全年 GDP 实际增速 6.6%,较 2017 年回落 0.2%,单季增速呈现单边下滑。价格方面,GDP 平减指数从 2017 年 2 季度开始,连续 7 个季度下滑至 2018 年末 2.9%。从经济增长动力来看,消费、投资、进出口三大需求均走弱,对 GDP 同比的拉动分别为 5.0%、2.1%、-0.6%。政策方面,央行货币政策稳健中性,实际操作中性偏松,引导市场利率下行,全年 M2 同比增长 8.1%,社会融资规模同比增长 9.8%,新增人民币贷款 16.17 万亿元。

本基金债券部分,加大利率债配置力度,并积极参与波段交易机会。同时,保持信用债中性久期,精选优质个券,优化信用结构,以提高组合的安全性和收益性。股票部分,以价值蓝筹为底仓,选择业绩确定性高且估值合理的标的,此外择机参与周期品和科技成长的波段交易机会。整

体组合保持适当杠杆，合理分配各类资产比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金单位净值为 1.0117 元，份额累计净值为 1.0117 元，本报告期内本基金净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准涨幅为-1.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年经济下行压力仍在，分项看，投资继续回落，结构上地产下滑幅度较大，同时基建企稳回升。受全球需求转弱影响，进出口难有增长起色。内需自然回升动力不足，终端消费也难以走高。因此，支持债券市场利率低位运行的基本面因素仍在存在。同时，我们也看到各项政策积极的一面，对民营和实体企业的扶持，对科技创新企业的鼓励等。权益市场经过一年的调整，目前整体市场的估值水平已经处于历史最低区间，经济下行和风险因素已经充分反映。2019 年，随着各项政策的出台和逐步实施，有望重新找到经济增长点，恢复融资需求，进入新一轮上升周期。

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。维持组合目前久期，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；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人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，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，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，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，本基金在每个封闭期内收益至少分配 1 次，每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 100%；

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

自 2018 年 11 月 23 日至 2018 年 12 月 20 日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本报告期末基金 2018 年度财务报告经德勤华永会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（德师报(审)字(19)第 P00135 号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                 |                                  |
| 银行存款            | 824,748.55                      | 1,319,153.66                     |
| 结算备付金           | 584,306.48                      | 1,936,363.64                     |
| 存出保证金           | 61,137.77                       | -                                |
| 交易性金融资产         | 37,659,743.00                   | 129,309,800.00                   |
| 其中：股票投资         | -                               | -                                |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 37,659,743.00                   | 129,309,800.00                   |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 贵金属投资           | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                               | 65,998,499.00                    |
| 应收证券清算款         | -                               | -                                |
| 应收利息            | 586,740.36                      | 2,526,562.39                     |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 39,716,676.16                   | 201,090,378.69                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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       | 4,000,000.00                    | -                                |
| 应付证券清算款         | -                               | -                                |
| 应付赎回款           | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         | 35,812.34                       | 204,206.93                       |
| 应付托管费           | 5,968.73                        | 34,034.49                        |
| 应付销售服务费         | 23,874.90                       | 193,167.37                       |
| 应付交易费用          | 210,780.78                      | 1,574.00                         |
| 应交税费            | 10,742.34                       | -                                |
| 应付利息            | 3,874.00                        | -                                |



|               |               |                |
|---------------|---------------|----------------|
| 应付利润          | -             | -              |
| 递延所得税负债       | -             | -              |
| 其他负债          | 209,000.00    | 90,000.00      |
| 负债合计          | 4,500,053.09  | 522,982.79     |
| <b>所有者权益：</b> |               |                |
| 实收基金          | 34,810,776.91 | 200,137,634.81 |
| 未分配利润         | 405,846.16    | 429,761.09     |
| 所有者权益合计       | 35,216,623.07 | 200,567,395.90 |
| 负债和所有者权益总计    | 39,716,676.16 | 201,090,378.69 |

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0117 元，基金份额总额 34,810,776.91 份。

2、本基金本报告期为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日，本基金基金合同于 2017 年 11 月 17 日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

## 7.2 利润表

会计主体：长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 11 月 17 日(基金合同<br>生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            | 8,589,977.51                              | 1,053,682.39   |
| 1. 利息收入                | 11,123,235.44                             | 1,061,799.10   |
| 其中：存款利息收入              | 86,047.66                                 | 29,275.62  |
| 债券利息收入                 | 10,813,400.21                             | 329,650.51   |
| 资产支持证券利息收入             | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             | 223,787.57                                | 702,872.97   |
| 其他利息收入                 | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | -2,977,694.48                             | -  |
| 其中：股票投资收益              | -5,840,901.78                             | -  |
| 基金投资收益                 | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 2,788,808.14                              | -  |
| 资产支持证券投资收益             | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | -   | -  |
| 股利收益                   | 74,399.16                                 | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 444,436.55                                | -8,116.71  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -   | -  |

|                            |              |            |
|----------------------------|--------------|------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | -            | -          |
| <b>减：二、费用</b>              | 8,009,422.95 | 623,921.30 |
| 1. 管理人报酬                   | 2,196,911.17 | 289,751.09 |
| 2. 托管费                     | 366,151.82   | 48,291.84  |
| 3. 销售服务费                   | 1,464,607.51 | 193,167.37 |
| 4. 交易费用                    | 447,595.70   | 1,077.00   |
| 5. 利息支出                    | 3,264,394.54 | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 3,264,394.54 | -          |
| 6. 税金及附加                   | 27,471.09    | -          |
| 7. 其他费用                    | 242,291.12   | 91,634.00  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 580,554.56   | 429,761.09 |
| 减：所得税费用                    | -            | -          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | 580,554.56   | 429,761.09 |

注：本基金本报告期为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日，本基金基金合同于 2017 年 11 月 17 日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）                        | 200,137,634.81                         | 429,761.09  | 200,567,395.90  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | 580,554.56  | 580,554.56      |
| 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）      | -165,326,857.90                        | -604,469.49 | -165,931,327.39 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 9.91                                   | 0.09        | 10.00           |
| 2. 基金赎回款                               | -165,326,867.81                        | -604,469.58 | -165,931,337.39 |
| 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） | -                                      | -           | -               |

|  |   |            |                |
|--|---|------------|----------------|
| 号填列)                                   |   |            |                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 34,810,776.91                               | 405,846.16 | 35,216,623.07  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年11月17日(基金合同生效日)至2017年12月31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）                        | 200,137,634.81                              | -          | 200,137,634.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 429,761.09 | 429,761.09     |
| 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）      | -   | -          | -              |
| 其中：1. 基金申购款                            | -   | -          | -              |
| 2. 基金赎回款                               | -   | -          | -              |
| 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）                        | 200,137,634.81                              | 429,761.09 | 200,567,395.90 |

注：本基金本报告期为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日，本基金基金合同于 2017 年 11 月 17 日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理

委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2017]510 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 200,137,634.81 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00489 号验资报告。基金合同于 2017 年 11 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信利尚一年定期开放混合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(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货、股票期权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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不高于 30%。封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。此外的每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率\*80%+中证 500 指数收益率\*20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 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 2017 年 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 11 月 17 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间及 2018 年度的经营成果和基

金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2017 年 11 月 17 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收

款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### -利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### -投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### -公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率逐日计提。

本基金的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。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 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，本基金在每个封闭期内收益至少分配 1 次，每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 100%；

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。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值



计算模型进行估值。

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,根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

根据《关于发布〈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〉的通知》(中基协发[2014]24号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市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。

## **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

### **7.4.5.3 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。

## **7.4.6 税项**

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》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《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[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关

税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 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，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                        | 与本基金的关系            |
|------------------------------|--------------------|
| 长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)     | 基金管理人、基金销售机构       |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)   | 基金托管人、基金销售机构       |
| 长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)       | 基金管理人的股东           |
| 上海海欣集团股份有限公司(以下简称“海欣集团”)     | 基金管理人的股东           |
| 上海彤胜投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤胜投资”) | 基金管理人的股东           |
| 上海彤骏投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤骏投资”) | 基金管理人的股东           |
| 武汉钢铁股份有限公司                   | 基金管理人的股东(股权转让前的股东) |
| 上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)   | 基金管理人的子公司          |
| 武汉钢铁有限公司                     | 基金管理人的股东(股权转让后的股东) |

注：(1) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，并获中国证券监督管理委员会《关于核

准长信基金管理有限责任公司变更股权的批复》(证监许可[2018]1905号),长信基金管理有限责任公司原股东武汉钢铁股份有限公司将其持有的长信基金管理有限责任公司 15.15%的股权全部转让给武汉钢铁有限公司。长信基金管理有限责任公司 2018 年 12 月 21 日已就股东变更事宜发布公告,股东变更为长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁有限公司、上海彤胜投资管理中心(有限合伙)和上海彤骏投资管理中心(有限合伙)。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方交易单元的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年11月17日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,196,911.17                | 289,751.09                                  |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 1,522,310.11                | 200,363.59                                  |

注:支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率确认,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.2%÷当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                                     |
|----------------|----------------------------------|---|
|                | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 11 月 17 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 366,151.82                       | 48,291.84                                   |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期  |
|---------------|---|
|               | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日            |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |
| 长信基金          | 111,442.71                                  |
| 中国工商银行        | 1,353,164.80                                |
| 合计            | 1,464,607.51                                |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间                                     |
|               | 2017 年 11 月 17 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |
| 长信基金          | 6,977.11                                    |
| 中国工商银行        | 186,190.26                                  |
| 合计            | 193,167.37                                  |

注：支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年数。

### 7.4.8.3 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未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

**7.4.8.5 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<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2017年11月17日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |           |
|--------|-----------------------------|-----------|---|-----------|
|        | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国工商银行 | 824,748.55                  | 46,180.50 | 1,319,153.66                                | 26,922.90 |

注：本基金通过“中国工商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等结算账户，于2018年12月31日相关余额为584,306.48元（2017年12月31日相关余额：1,936,363.64元）。

**7.4.8.6 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。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 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。

**7.4.9.2 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。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末未持有银行间正回购。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2018年12月31日止，本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余额为4,000,000.00元，于2019年1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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 37,659,743.00 | 94.82         |
|    | 其中：债券             | 37,659,743.00 | 94.82         |
|    | 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      | 1,409,055.03  | 3.55          |
| 8  | 其他各项资产            | 647,878.13    | 1.63          |
| 9  | 合计                | 39,716,676.16 | 100.00        |

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

### 8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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  | 000869 | 张裕A  | 10,855,849.80 | 5.41            |
| 2  | 600859 | 王府井  | 10,093,303.13 | 5.03            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3  | 600600 | 青岛啤酒 | 9,514,978.00 | 4.74 |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 7,032,625.15 | 3.51 |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 5,968,389.00 | 2.98 |
| 6  | 002236 | 大华股份 | 5,130,711.00 | 2.56 |
| 7  | 600535 | 天士力  | 5,082,828.98 | 2.53 |
| 8  | 002368 | 太极股份 | 4,985,719.99 | 2.49 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 4,832,610.00 | 2.41 |
| 10 | 600196 | 复星医药 | 4,699,772.00 | 2.34 |
| 11 | 002293 | 罗莱生活 | 4,688,649.68 | 2.34 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 4,521,478.00 | 2.25 |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 3,977,000.00 | 1.98 |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 3,959,031.80 | 1.97 |
| 15 | 300433 | 蓝思科技 | 3,704,893.00 | 1.85 |
| 16 | 600967 | 内蒙一机 | 3,666,910.88 | 1.83 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 3,374,991.00 | 1.68 |
| 18 | 601336 | 新华保险 | 3,307,438.00 | 1.65 |
| 19 | 601800 | 中国交建 | 3,227,008.40 | 1.61 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 3,185,142.00 | 1.59 |

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。

#### 8.4.2 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  | 000869 | 张裕A  | 11,037,086.60 | 5.50           |
| 2  | 600859 | 王府井  | 9,653,374.45  | 4.81           |
| 3  | 600600 | 青岛啤酒 | 9,405,472.00  | 4.69           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 7,432,658.30  | 3.71           |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 5,180,148.14  | 2.58           |
| 6  | 002236 | 大华股份 | 5,146,235.00  | 2.57           |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 4,857,040.00  | 2.42           |
| 8  | 600535 | 天士力  | 4,790,931.60  | 2.39           |
| 9  | 002368 | 太极股份 | 4,705,001.00  | 2.35           |
| 10 | 002293 | 罗莱生活 | 4,623,700.00  | 2.31           |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 4,262,383.34  | 2.13           |
| 12 | 600016 | 民生银行 | 3,932,283.00  | 1.96           |
| 13 | 600196 | 复星医药 | 3,843,761.00  | 1.92           |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 3,485,320.00  | 1.74           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 600967 | 内蒙一机 | 3,405,000.00 | 1.70 |
| 16 | 601800 | 中国交建 | 3,214,057.00 | 1.60 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 3,195,854.00 | 1.59 |
| 18 | 601336 | 新华保险 | 3,140,716.00 | 1.57 |
| 19 | 300433 | 蓝思科技 | 2,989,677.11 | 1.49 |
| 20 | 002281 | 光迅科技 | 2,928,809.64 | 1.46 |

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。

### 8.4.3 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 | 151,955,095.19 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 146,114,193.41 |

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。

### 8.5 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      | 7,163,900.00  | 20.34        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,042,000.00  | 5.80         |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,042,000.00  | 5.80         |
| 4  | 企业债券      | 28,453,843.00 | 80.80        |
| 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        | 37,659,743.00 | 106.94       |

### 8.6 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  | 010107 | 21 国债(7) | 50,000 | 5,147,500.00 | 14.62        |
| 2  | 136732 | 16 穗建 05 | 33,900 | 3,368,643.00 | 9.57         |
| 3  | 143032 | 17 杭旅 01 | 30,000 | 3,051,000.00 | 8.66         |
| 4  | 136057 | 15 华发 01 | 30,000 | 3,048,600.00 | 8.66         |
| 5  | 143081 | 17 长电 01 | 30,000 | 3,030,900.00 | 8.61         |



## **8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名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。

## **8.8 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。

## **8.9 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。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 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。

### **8.11.2 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。

### **8.11.3 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。

## **8.12 投资组合报告附注**

### **8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

### **8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

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。

**8.12.3 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   | 61,137.77  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 586,740.36 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 647,878.13 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本期末未持有可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票。

**8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 606          | 57,443.53     | 0.00  | 0.00%      | 34,810,776.91 | 100.00%    |

### 9.2 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 | 0.00      | 0.00%    |

### 9.3 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                 |

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017年11月17日）基金份额总额 | 200,137,634.81 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 200,137,634.81 |
| 本报告期期间基金总申购份额              | 9.91           |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额            | 165,326,867.81 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 34,810,776.91  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 11.2 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2018 年 8 月 28 日起，本基金管理人增聘安昀先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人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》。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 11.5 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会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计的报酬为人民币 50,000.00 元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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<br>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 | 佣金        | 占当期佣金 |    |
|      |            |      |       |           |       |    |

|               |   |                | 成交总额的比<br>例 |            | 总量的比例  |   |
|---------------|---|----------------|-------------|------------|--------|---|
| 宏源证券          | 2 | 263,122,940.49 | 88.28%      | 245,046.43 | 90.70% | - |
| 国海证券          | 1 | 21,886,976.69  | 7.34%       | 18,194.92  | 6.73%  | - |
| 国信证券（已<br>退租） | 2 | 13,059,371.42  | 4.38%       | 6,938.39   | 2.57%  | - |
| 天风证券          | 1 | -              | -           | -          | -      | - |
| 西南证券          | 1 | -              | -           | -          | -      | - |
| 华安证券          | 1 | -              | -           | -          | -      | - |
| 国信证券          | 1 | -              | -           | -          | -      | - |
| 安信证券          | 2 | -              | -           | -          | -      | - |
| 申银万国（已<br>退租） | 1 | -              | -           | -          | -      | - |
| 广州证券          | 1 | -              | -           | -          | -      | - |

### 11.7.2 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额             | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额<br>的比例 |
| 宏源证券          | 392,178,687.49 | 71.82%               | 3,826,600,000.00 | 77.31%                     | -    | -                        |
| 国海证券          | 15,006,552.34  | 2.75%                | -                | -                          | -    | -                        |
| 国信证券<br>（已退租） | 138,841,246.06 | 25.43%               | 1,123,100,000.00 | 22.69%                     | -    | -                        |
| 天风证券          | -              | -                    | -                | -                          | -    | -                        |
| 西南证券          | -              | -                    | -                | -                          | -    | -                        |
| 华安证券          | -              | -                    | -                | -                          | -    | -                        |
| 国信证券          | -              | -                    | -                | -                          | -    | -                        |

|               |   |   |   |   |   |   |
|---------------|---|---|---|---|---|---|
| 安信证券          | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国<br>(已退租) | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券          | - | - | - | - | - | - |

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化如下：

退租申银万国证券交易单元 1 个，国信证券交易单元 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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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  | -              | -                                  | -            | -    | -    | -            | -      |
| 个人  | 1              | 2018 年 11 月 26 日至 2018 年 12 月 31 日 | 7,000,630.00 | 0.00 | 0.00 | 7,000,630.00 | 20.11% |
| 产品特有风险  |                |                                    |              |      |      |              |        |
| <p>1、基金净值大幅波动的风险<br/>单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险<br/>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险<br/>单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能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。</p> |                |                                    |              |      |      |              |        |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019 年 3 月 29 日