

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

金

2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 27 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）根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信双利优选混合	
基金主代码	519991	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 6 月 19 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	946,734,727.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
下属分级基金场内简称:	CXSLA	-
下属分级基金的交易代码:	519991	006396
下属分级基金的前端交易代码	519991	-
下属分级基金的后端交易代码	519990	-
报告期末下属分级基金的份额总额	945,820,241.28 份	914,486.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票和债券等金融资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下，谋求超越比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为主动式混合型基金，以战略性资产配置（SAA）策略体系为基础决定基金资产在股票类、固定收益类等资产中的配置。将股票价值优选策略模型和修正久期控制策略模型作为个股和债券的选择依据，投资于精选的优质股票和债券，构建动态平衡的投资组合，实现基金资产超越比较基准的稳健增值。
业绩比较基准	中证 800 指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险和收益高于债券基金和货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏高的投资品种。

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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95599
传真	021-61009800	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

§ 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	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	57,183,975.75	133,516.28
本期利润	244,659,230.14	50,229.07
加权平均基金份额本期利润	0.2737	0.0795
本期基金份额净值增长率	21.76%	22.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0659	0.2085
期末基金资产净值	1,248,634,652.76	1,242,989.48
期末基金份额净值	1.320	1.359

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

长信双利优选混合 A

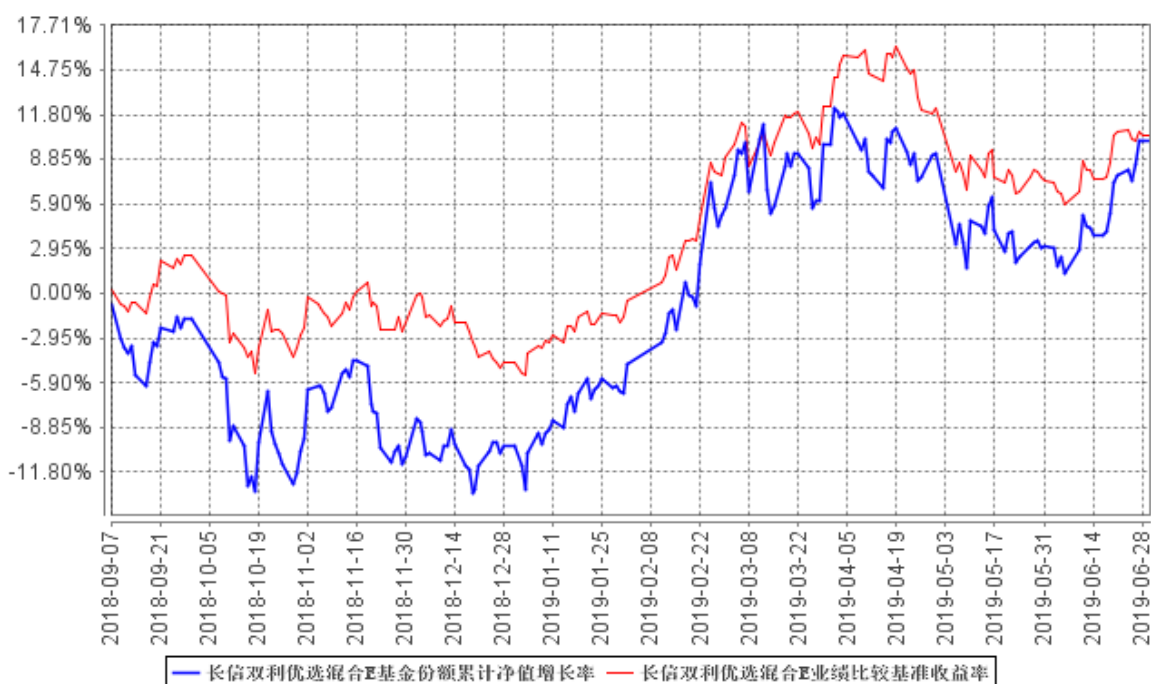
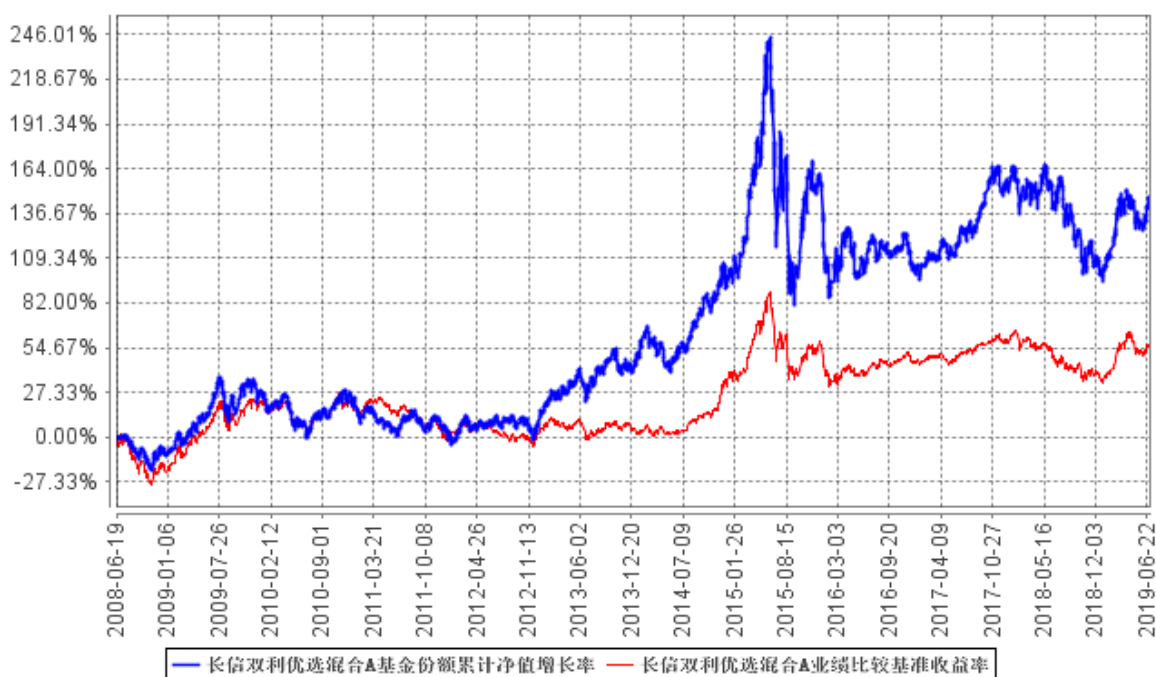
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.71%	0.98%	2.76%	0.72%	3.95%	0.26%
过去三个月	0.18%	1.36%	-1.70%	0.94%	1.88%	0.42%
过去六个月	21.76%	1.49%	15.68%	0.94%	6.08%	0.55%
过去一年	-1.15%	1.49%	5.87%	0.92%	-7.02%	0.57%
过去三年	14.65%	1.19%	10.53%	0.67%	4.12%	0.52%
自基金合同生效起至今	146.08%	1.49%	55.81%	1.00%	90.27%	0.49%

长信双利优选混合 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	6.76%	0.97%	2.76%	0.72%	4.00%	0.25%
过去三个月	0.25%	1.37%	-1.70%	0.94%	1.95%	0.43%
过去六个月	22.41%	1.50%	15.68%	0.94%	6.73%	0.56%
自份额增加 日起至今	10.09%	1.51%	10.40%	0.94%	-0.31%	0.57%

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 2018 年 9 月 7 日起对长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 E 类份额。

2、长信双利优选混合 A 图示日期为 2008 年 6 月 19 日至 2019 年 6 月 30 日，长信双利优选混合 E 图示日期为 2018 年 9 月 7 日（份额增加日）至 2019 年 6 月 30 日。

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

§ 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 1.65 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 65 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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信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）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利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		
安昀	长信内需成长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、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、副总经理、投资决策委员会执行委员	2017年11月2日	-	13年	经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015年5月6日至2016年9月6日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016年9月8日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任公司总经理助理，现任公司副总经理和投资决策委员会执行委员、长信内需成长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、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

祝昱丰	长信创新驱动股票型证券投资基金和长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019年2月19日	-	5年	金融学硕士，上海交通大学金融学硕士毕业，2014年至2015年在光大保德信基金管理有限公司投资研究部门担任初级研究员职务。2015年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾担任研究发展部行业研究员、基金经理助理。现任长信创新驱动股票型证券投资基金和长信双利优选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。

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

我们建议多看存量，少看边际。一方面是因为存量的位置决定了边际变化的效果，比如你在平地上推人一把的效果会远小于在悬崖边，再比如烈火遇上干柴的效果要远好于遇上湿柴。另一方面是因为边际变化很难有效预测，但存量相对容易观察，好比势能大小容易测量，由于能量守恒，势能转化成的动能也容易测量，但何时转化，什么因素触发，无从得知。再一方面，这两年的贸易谈判是一个无法预测结果但却无法忽略其结果的边际变化，各种结果对于经济和金融的影响都是巨大的，无人知道未来，所以我们只能降低对这个边际因素的依赖，着重于衡量当下各类资产和行业的势能，持有势能高的，规避势能低的。

我们大体是从三个角度去判断资产和行业，一是景气度位置，二是景气度趋势，三是估值位置。其中景气和估值位置都是存量因素，而趋势是边际因素。景气度趋势的判断固然重要，但本质上这是对未来的预测，凡人的置信度都不会很高。所以景气位置是给景气趋势的判断增信的，景气度在高位的时候，判断未来景气度继续上升的置信度就偏小，而判断未来景气度下滑的置信度就相对高，反之则反是。估值的位置是衡量资产定价周期的，历史的和国际的估值区间都是在各种复杂情况下真刀真枪交易出来的，绝大多数情况下置信度是较高的。这三个因素综合作用，会帮助我们对某个交易做出评级，比如景气位置在低位，估值位置也在低位，又跟踪到景气趋势向上，则做多评级很高；若景气度在高位，估值位置也在高位，又跟踪到景气趋势向下，则做空评级很高。其他情况下，则需要等待和观察，任何只注重片面因素的交易都是评级不高的。在这三个因素中间，我们更为看重势能部分（景气位置和估值位置），相对看淡动能部分（景气趋势），因为势能必然转换为动能，只是时间和方式不确定，我们需要确保的是运用一定的交易技巧和止损保护，使得自己不被甩出局。当然，要从资产或行业本身的特质出发，给予这三个因素不同的权重，对于景气度变化较大的行业，三个因素都很重要，而对于景气度较平稳的行业，估值位置更重要。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信双利优选混合 A 份额净值为 1.320 元，份额累计单位净值为 2.078 元，报告期长信双利优选混合 A 份额净值增长率为 21.76%；长信双利优选混合 E 份额净值为 1.359 元，

份额累计单位净值为 1.378 元，本报告期长信双利优选混合 E 份额净值增长率为 22.41%，同期业绩比较基准收益率为 15.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济依然处于短周期的景气低位，但摩擦结果对于中长期景气走向的影响非常大，建议右侧交易。从短周期看，现在依然是衰退后期，今年一季度呈现出的复苏期特征被四月开始的主动收紧和五月的谈判波折打断了。中长周期的结果和走向很难判断，但他会影响对短周期的定位，坦白说我们也很困惑。从估值位置看，一方面总体上处于历史的 45%，可上可下；另一方面，白马股（特别是消费）都处于历史的 80%分位或以上，风险收益比不好。所以，我们总体建议等待，做右侧交易。

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及其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，基金管理人于 2019 年 4 月 10 日发布《长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的分红公告》，收益分配基准日为 2019 年 4 月 8 日，权益登记日为 2019 年 4 月 12 日，现金红利发放日 2019 年 4 月 16 日。分红总额 14,885,288.29 元，其中现金分红 11,056,262.52

元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金收益分配后各类基金份额的份额净值在财务日不能低于面值；
- 5、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 7、基金每年分红次数最多不超过 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 30%。若年度分红 12 次后，基金再次达到分红条件，则可分配收益滚存到下一年度进行分配；
- 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遵规守信情况声明

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，对本基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 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遵规守信、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：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	115,156,950.57	3,729,619.20
结算备付金	2,452,277.69	1,771,125.66
存出保证金	702,860.95	682,876.79
交易性金融资产	1,145,542,292.63	1,389,783,106.46
其中：股票投资	978,536,242.43	1,093,558,874.66
基金投资	-	-
债券投资	167,006,050.20	296,224,231.80
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	-	-
应收证券清算款	-	2,507,352.31
应收利息	1,474,205.20	6,248,110.00
应收股利	-	-
应收申购款	26,454.91	17,674.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,265,355,041.95	1,404,739,865.40
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
负 债：		
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	-	-
应付证券清算款	9,999,793.52	-
应付赎回款	847,081.91	47,782.22
应付管理人报酬	1,325,821.74	1,806,038.50
应付托管费	220,970.27	301,006.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,817,637.07	556,195.28
应交税费	48,800.44	48,949.24

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	217,294.76	399,069.73
负债合计	15,477,399.71	3,159,041.41
所有者权益：		
实收基金	946,734,727.40	1,274,545,343.23
未分配利润	303,142,914.84	127,035,480.76
所有者权益合计	1,249,877,642.24	1,401,580,823.99
负债和所有者权益总计	1,265,355,041.95	1,404,739,865.40

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长信双利优选混合 A 份额净值 1.320 元，长信双利优选混合 E 份额净值 1.359 元，基金份额总额为 946,734,727.40 份，其中长信双利优选混合 A 份额 945,820,241.28 份；长信双利优选混合 E 份额 914,486.12 份。

6.2 利润表

会计主体：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	261,651,365.46	-25,380,190.50
1.利息收入	2,027,469.09	2,373,000.14
其中：存款利息收入	255,145.40	320,023.86
债券利息收入	1,772,323.69	2,052,976.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	71,443,855.01	22,467,939.56
其中：股票投资收益	45,602,534.90	17,704,328.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	19,826,591.78	-9,082,602.01
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	6,014,728.33	13,846,212.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	187,391,967.18	-50,551,808.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	788,074.18	330,677.80
减：二、费用	16,941,906.25	14,383,140.84
1. 管理人报酬	8,248,706.28	7,884,723.11
2. 托管费	1,374,784.35	1,314,120.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,184,709.82	5,023,009.46
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	2,359.51	1,409.03
7. 其他费用	131,346.29	159,878.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	244,709,459.21	-39,763,331.34
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	244,709,459.21	-39,763,331.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	1,274,545,343.23	127,035,480.76	1,401,580,823.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	244,709,459.21	244,709,459.21
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）	-327,810,615.83	-53,716,736.84	-381,527,352.67
其中：1.基金申购款	306,119,033.49	81,397,504.41	387,516,537.90
2.基金赎回款	-633,929,649.32	-135,114,241.25	-769,043,890.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-14,885,288.29	-14,885,288.29

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）	946,734,727.40	303,142,914.84	1,249,877,642.24
项目	上年度可比期间 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）	457,079,838.66	220,713,169.88	677,793,008.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,763,331.34	-39,763,331.34
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）	884,351,385.04	377,783,316.80	1,262,134,701.84
其中：1.基金申购款	1,107,970,611.95	485,195,099.86	1,593,165,711.81
2.基金赎回款	-223,619,226.91	-107,411,783.06	-331,031,009.97
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）	-	-82,577,385.41	-82,577,385.41
五、期末所有者权益（基金净值）	1,341,431,223.70	476,155,769.93	1,817,586,993.63

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

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金（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〕357号文《关于核准长信双利优选灵活配置混合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责任公司向社会公

开发行募集，基金合同于 2008 年 6 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 511,032,952.17 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，各类份额的注册登记机构分别为中国证券登记结算有限责任公司和长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经本基金的基金管理人和基金托管人协商一致，自 2018 年 9 月 7 日起，根据注册登记机构的不同对本基金进行份额分类，原有基金份额归为 A 类份额，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，同时增设 E 类份额，注册登记机构为长信基金管理有限责任公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票部分包括所有在国内依法发行的 A 股；债券部分包括国债、金融债、高信用等级企业债和可转债等；货币市场工具包括各种回购、央行票据、短期融资券、同业存款以及剩余期限在 1 年以内的短期债券等。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。

本基金投资组合中，股票类资产的投资比例为基金资产的 30-80%；固定收益类资产的投资比例为基金资产的 15-65%；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%；投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及中国证监会的规定。当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，基金管理人在履行相关程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金股票投资部分的业绩比较基准为中证 800 指数，债券投资部分为上证国债指数，复合业绩比较基准为：中证 800 指数×60%+上证国债指数×40%。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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。

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 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 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均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,248,706.28	7,884,723.11
其中：支付销售机构的客户维护费	728,273.41	901,836.66

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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×1.5%/当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,374,784.35	1,314,120.49

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 0.25% 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×0.25%/当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
农业银行	115,156,950.57	213,040.30	68,987,486.13	253,589.72

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2019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（2018年12月31日：同）

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

6.4.8 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	认购新发证券	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	认购新发证券	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	978,536,242.43	77.33
	其中：股票	978,536,242.43	77.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	167,006,050.20	13.20
	其中：债券	167,006,050.20	13.20
	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	117,609,228.26	9.29
8	其他各项资产	2,203,521.06	0.17
9	合计	1,265,355,041.95	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	363,431.25	0.03
C	制造业	625,327,897.84	50.03
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	179,432,252.78	14.36
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	59,067,723.04	4.73
J	金融业	33,869.94	0.00
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	65,083,504.64	5.21
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	49,227,562.94	3.94
S	综合	-	-
	合计	978,536,242.43	78.29

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前十名股票投资明细

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	603589	口子窖	1,136,600	73,219,772.00	5.86
2	000661	长春高新	208,690	70,537,220.00	5.64
3	603708	家家悦	2,876,017	65,630,707.94	5.25
4	601933	永辉超市	6,412,404	65,470,644.84	5.24
5	603160	汇顶科技	470,012	65,237,665.60	5.22
6	603259	药明康德	750,848	65,083,504.64	5.21
7	000651	格力电器	1,075,600	59,158,000.00	4.73
8	300383	光环新网	3,519,864	59,028,119.28	4.72
9	601633	长城汽车	7,052,674	58,325,613.98	4.67
10	300630	普利制药	966,421	55,685,178.02	4.46

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

7.4 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	300253	卫宁健康	121,979,565.02	8.70
2	603160	汇顶科技	115,169,710.87	8.22
3	600622	光大嘉宝	94,187,819.36	6.72
4	603259	药明康德	89,951,583.79	6.42

5	603589	口子窖	82,927,817.66	5.92
6	002912	中新赛克	82,894,419.37	5.91
7	601318	中国平安	79,987,675.57	5.71
8	600036	招商银行	79,987,616.84	5.71
9	300630	普利制药	79,952,658.46	5.70
10	601933	永辉超市	69,966,359.23	4.99
11	603708	家家悦	68,201,529.19	4.87
12	300383	光环新网	67,045,144.06	4.78
13	000001	平安银行	65,994,954.19	4.71
14	002439	启明星辰	63,979,282.00	4.56
15	000661	长春高新	63,965,963.16	4.56
16	601166	兴业银行	62,995,456.50	4.49
17	300017	网宿科技	61,985,087.08	4.42
18	601633	长城汽车	60,300,612.74	4.30
19	000858	五粮液	59,993,254.67	4.28
20	601128	常熟银行	59,987,906.20	4.28
21	000596	古井贡酒	59,982,205.96	4.28
22	603369	今世缘	59,401,635.20	4.24
23	000651	格力电器	57,987,835.73	4.14
24	300496	中科创达	57,455,532.37	4.10
25	300124	汇川技术	50,187,556.33	3.58
26	601998	中信银行	49,999,758.00	3.57
27	601009	南京银行	49,997,656.64	3.57
28	603866	桃李面包	49,993,441.66	3.57
29	300144	宋城演艺	47,994,089.87	3.42
30	603816	顾家家居	45,985,292.05	3.28
31	300078	思创医惠	45,175,082.36	3.22
32	002697	红旗连锁	43,891,793.00	3.13
33	600016	民生银行	42,998,360.00	3.07
34	000333	美的集团	39,992,187.00	2.85
35	600132	重庆啤酒	34,975,177.47	2.50
36	600104	上汽集团	29,995,313.61	2.14
37	601689	拓普集团	29,993,264.56	2.14

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	603708	家家悦	132,587,266.92	9.46
2	601877	正泰电器	131,570,393.84	9.39
3	300383	光环新网	127,484,066.03	9.10
4	601933	永辉超市	123,678,020.51	8.82
5	603589	口子窖	118,425,341.83	8.45
6	002410	广联达	118,102,176.09	8.43
7	603039	泛微网络	115,578,259.48	8.25
8	300253	卫宁健康	115,049,936.39	8.21
9	600622	光大嘉宝	109,458,612.68	7.81
10	300454	深信服	100,508,168.56	7.17
11	600271	航天信息	94,257,130.05	6.73
12	603259	药明康德	86,449,822.30	6.17
13	600036	招商银行	81,375,847.24	5.81
14	601318	中国平安	77,928,263.45	5.56
15	002912	中新赛克	74,052,205.65	5.28
16	300496	中科创达	74,025,162.03	5.28
17	603160	汇顶科技	69,545,167.51	4.96
18	002439	启明星辰	63,381,479.00	4.52
19	000858	五粮液	62,951,210.74	4.49
20	300596	利安隆	62,586,372.44	4.47
21	603816	顾家家居	62,417,047.77	4.45
22	300017	网宿科技	62,389,487.20	4.45
23	603369	今世缘	61,513,655.07	4.39
24	000596	古井贡酒	61,043,091.00	4.36
25	601166	兴业银行	56,641,215.81	4.04
26	000001	平安银行	56,617,454.41	4.04
27	601128	常熟银行	56,123,397.20	4.00
28	300373	扬杰科技	49,900,258.25	3.56
29	601009	南京银行	47,675,840.67	3.40
30	601998	中信银行	47,447,692.92	3.39
31	300078	思创医惠	41,908,309.21	2.99
32	600016	民生银行	41,764,950.43	2.98
33	000333	美的集团	41,050,020.50	2.93
34	300630	普利制药	34,606,081.70	2.47

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	2,391,458,123.03
卖出股票收入（成交）总额	2,738,288,194.58

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	50,027,000.00	4.00
	其中：政策性金融债	50,027,000.00	4.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	116,979,050.20	9.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	167,006,050.20	13.36

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	113009	广汽转债	451,320	48,020,448.00	3.84
2	113020	桐昆转债	359,810	42,752,624.20	3.42
3	180410	18农发10	300,000	30,021,000.00	2.40
4	110031	航信转债	244,550	26,205,978.00	2.10
5	180209	18国开09	200,000	20,006,000.00	1.60

7.7 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。

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股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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 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。

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	702,860.95

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,474,205.20
5	应收申购款	26,454.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,203,521.06

7.12.4 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	113009	广汽转债	48,020,448.00	3.84
2	113020	桐昆转债	42,752,624.20	3.42
3	110031	航信转债	26,205,978.00	2.10

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 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
长信双利优选混合 A	15,744	60,074.96	761,612,213.05	80.52%	184,208,028.23	19.48%
长信双利优选混合 E	16	57,155.38	0.00	0.00%	914,486.12	100.00%
合计	15,760	60,072.00	761,612,213.05	80.45%	185,122,514.35	19.55%

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	长信双利优选混合 A	20,332.12	0.00%
	长信双利优选混合 E	0.00	0.00%
	合计	20,332.12	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	长信双利优选混合 A	0
	长信双利优选混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信双利优选混合 A	0
	长信双利优选混合 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信双利优选混合 A	长信双利优选混合 E
基金合同生效日（2008 年 6 月 19 日）基金份额总额	511,032,952.17	-
本报告期期初基金份额总额	1,274,544,519.67	823.56
本报告期期间基金总申购份额	305,077,770.20	1,041,263.29
减：本报告期期间基金总赎回份额	633,802,048.59	127,600.73
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	945,820,241.28	914,486.12

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2019 年 3 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

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公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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	
海通证券	1	1,439,015,498.15	28.06%	1,196,255.38	29.98%	-
广发证券	1	727,665,536.15	14.19%	604,908.31	15.16%	-
长城证券	1	628,282,560.09	12.25%	396,634.85	9.94%	-
国盛证券	1	564,469,787.77	11.01%	356,349.63	8.93%	-
招商证券	1	321,449,686.42	6.27%	299,364.30	7.50%	-
信达证券	2	317,193,879.43	6.19%	200,243.71	5.02%	-
国金证券	1	254,389,758.47	4.96%	211,475.42	5.30%	-
太平洋证券	1	223,379,974.18	4.36%	163,357.21	4.09%	-
华泰证券	1	195,968,303.21	3.82%	162,910.69	4.08%	-
银河证券	1	127,145,433.48	2.48%	105,696.42	2.65%	-
西南证券	1	126,563,015.40	2.47%	105,209.13	2.64%	-
中邮	1	104,894,573.59	2.05%	97,687.96	2.45%	-
中国国际金融有限公司	1	97,297,610.68	1.90%	90,615.62	2.27%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	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
海通证券	28,337,202.10	16.62%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	114,048,784.30	66.90%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中邮	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	28,090,973.20	16.48%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

（2）选择程序：

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 27 日