

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信上证港股通指数型发起式
基金主代码	519931
交易代码	519931
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 15 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,191,630.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金 被动式指数基金，原则上 用 复 法， 份股在上证港股通指数中的基准 重 指数 化投资组合，并根据标的指数 份股及其 重的 化 进行 应的 整。 期 份股发生 整和 份股发生配股、增发、分 等行 ，或 基金的 和 等对本基金跟踪 标的指数的效 带来 ，或 情况 导 动性不 ，或其 原 导 法有效复 和 跟踪标的指数 ，基金管理人 以对投资组合管理进 行 通和 整，并 之以金 生产品投资管理 等， 跟踪误差 在限定的 之内。
业绩比较基准	95 上证港股通指数收益率 5 同期 行 期存 利率
风险收益	本基金 股 型基金，风险与收益 于 合型基金、 券型基金与 基金。本基金 指数型基金， 主要 用 复 法跟踪标的指数的表现， 有与标 的指数、以及标的指数所代表的股 的风险 收益 。

2.3 基金管理人和基金托管人

目	基金管理人	基金托管人
---	-------	-------

称		长信基金管理有限责任公司	国泰君安证券股份有限公司
信 责人		021 61009999	021 38676252
		. .	222 .
务		4007005566	95521
真		021 61009800	021 38677819

2.4 信 方式

载基金半年度报告正文的管理人	. . .
基金半年度报告	上 新 中 68 9 、上 新 中 68 32

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额 单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 2017 年 1 月 1 日	2017 年 6 月 30 日
本期已实现收益		257,643.37
本期利润		2,077,975.72
均基金份额本期利润		0.1166
本期基金份额净值增长率		11.84
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 2017 年 6 月 30 日	
期末 分配基金份额利润		0.0091
期末基金资产净值		20,439,936.14
期末基金份额净值		1.124

：1、本期已实现收益指基金本期利 收 、投资收益、其 收 不 公 值 动收益用的 额，本期利润 本期已实现收益 上本期公 值 动收益。

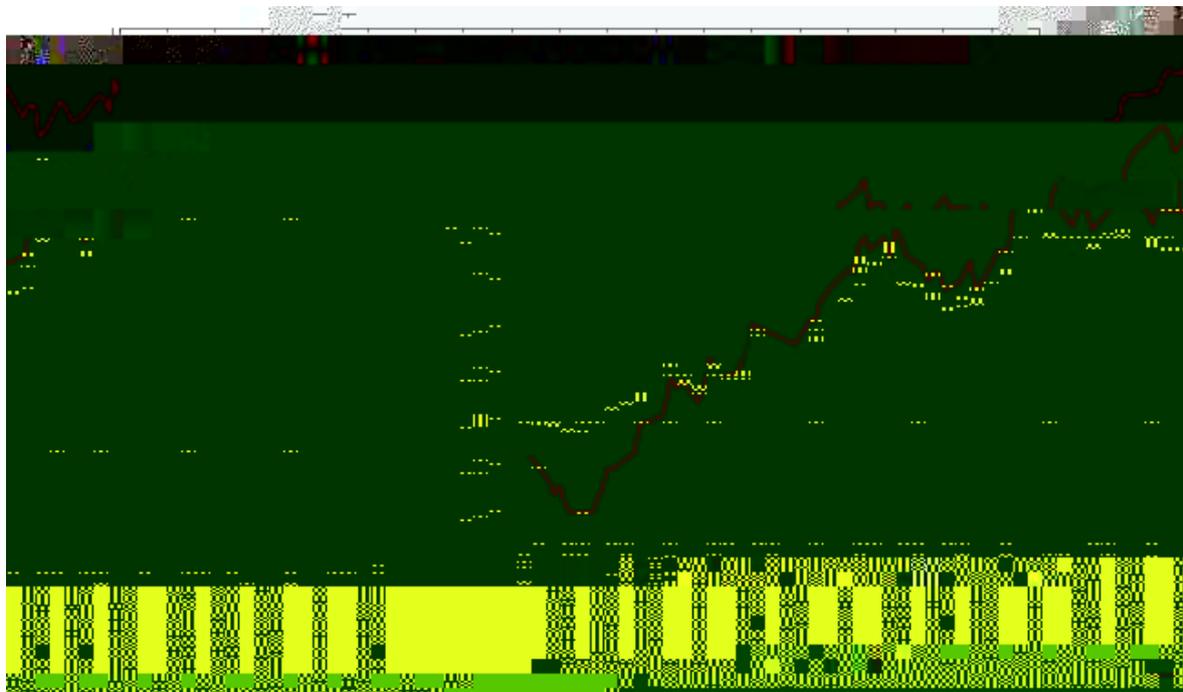
2、所述基金业绩指标不 有人 或交易基金的 用 ， 式基金交易金、开放式基金的 、 利 投资 、基金 等 ，计 用 实 收益 要于所 数字。

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

段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差		
过 一个月	0.27	0.63	0.91	0.60	0.64	0.03
过 三个月	4.95	0.56	6.29	0.57	1.34	0.01
过 个月	11.84	0.60	17.00	0.60	5.16	0.00
自基金合同生效起至	12.40	0.57	14.70	0.62	2.30	0.05

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



：1、本基金基金合同生效日 2016 年 12 月 15 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运
作 间未 一年。 示日期 2016 年 12 月 15 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、 基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内 期。报告期末已完
但报告期末 束不 一年 期 束 ，本基金的 投资比 已 合基金合同的约
定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经

长信基金管理有限责任公司 经中国证 会证 基金字 2003 63 文 准，由长 证券 股份有限公司、上 股份有限公司、 股份有限公司共同发起 立， 资本 1.65 人 ，目前股 ：长 证券股份有限公司 44.55 、上 股份有限公司 31.21 、 股份有限公司 15.15 、上 投资管理中 有限合 4.55 、上 投资管理中 有限合 4.54 。

至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 开放式基金， 长信利 收益开放式证 券投资基金、长信 利 合型证券投资基金、长信金利 合型证券投资基金、长信增利 动 策 合型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信利 券型证 券投资基金、长信 利 合型证券投资基金、长信量化 合型证券投资基金、长信 国 标准 100 等 重指数增 型证券投资基金、长信利 券型证券投资基金 、长信内 长 合型证券投资基金、长信 券型证券投资基金、长信利 券型证券投资基金 、长信 一年定期开放 券型证券投资基金、长信 券型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信量化中小 股 型证券投资基金、长信新利 配 合型证券投资基金、长信利 券型证券投资基金、长信利盈 配 合型证券投资基 金、长信利 配 合型证券投资基金、长信 利 配 合型证券投资基金、长信 进 配 合型证券投资基金、长信量化 策 股 型证券投资基金、长信 保 行业 配 合型证券投资基金 、长信中证一带一 主 指数分 证券投资基金、长信 一 年定期开放 券型证券投资基金、长信 一年定期开放 券型证券投资基金、长信利保 券型证券投资基金、长信 安 一年定期开放 券型证券投资基金、长信中证 主 指数型证券投资基金 、长信金 一年定期开放 券型证券投资基金、长信 一 年定期开放 券型证券投资基金、长信利泰 配 合型证券投资基金、长信 收益一年定 期开放 券型证券投资基金、长信 券型证券投资基金、长信利发 券型证券投资基金、长 信 泰 一年定期开放 券型证券投资基金、长信 信 行业量化 配 合型证券投资 基金、长信 一年定期开放 券型证券投资基金、长信 利半年定期开放 合型证券投资 基金、长信 新 动股 型证券投资基金、长信 益 券型证券投资基金、长信利信 配

合型证券投资基金、长信 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
 投资基金、长信 半年 券型证券投资基金、长信国 量化 配 合型证券投资基
 金、长信中证上 发 主 指数型证券投资基金 。

4.1.2 基金经理 或基金经理小组 及基金经理 理简介

	务	任本基金的基金经理 理 期限		证券 业年 限	说明
		任 日期	离任日期		
	任本基金的 基金经理	2016年12 月15日	2017年6月 28日	20年	任本基金的基金经 理
	长信 收益 一年定期开放 券型证券投 资基金、长信 国标准 100等 重指 数增 型证券 投资基金和长 信上证港股通 指数型发起式 证券投资基金 的基金经理、 国 业务 总	2017年4 月25日		11年	管理 ， 大 管理 业， 在 投资发 有限公司担 任 、 和资产 管理有限公司担任 ， 2017年 3月 长信基金管 理有限责任公司，现 任国 业务 总 、长信 收益一 年定期开放 券型证 券投资基金、长信 国标准 100等 重指数增 型证券投 资基金和长信上证港 股通指数型发起式证 券投资基金的基金经 理。
	长信 国标准 100等 重指数增 型 证券投资基 金、长信 收益一年定期 开放 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 的基金经理 理	2017年5 月9日		2年	金 ， 业于 国 大 ， 有 基金 业资格。 任 于中国 业 行上 分行、易 务 有限公司， 2016年4月 长 信基金管理有限责任 公司，现任长信 国 标准 100等 重 指数增 型证券投资 基金、长信 收益 一年定期开放 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的基金经理 理。
--	--	--	--	--	---------------------------

：1、任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新增或 更以 新增 更基金经理的公告 日 准

2、本基金基金经理的证券 业年限以基金经理进 证券业务 的 作经 间计 标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格 了 中 人 共和国证券投资基金法 及其 有 法律 法规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份额 有人 求利益，不存在 基金份额 有人利 益的行 。

本基金 续以 信于 、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信 用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和严格 投资风险的前提 ， 力 基金份额 有人 求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公 交易情况的 说明

4.3.1 公 交易 度的 行情况

本报告期内，公司已实行公 交易 度，并 立公 交易 度 ，已 立投资决策 ， 交易 行 的内 ，并通过 作 度、 和 手段保证公 交易原则的实现。同 ，公司已通过对投资交易行 的 、分 和信 来 对公 交易过 和 的 。

4.3.2 交易行 的 说明

本报告期内，完 有 指数的 比 进行投资的组合 ，其 投资组合未发生 与交易所公开 同日 交易 交较 的 交易量超过 证券 日 交量的 5 的情 ，未 发现 交易行 。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策 和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策 和运作分

2017 年上半年港股上 ， 生指数上半年 了 17.11 ，二 度 于一 度 ， 大主要 ，港股上半年表现 。其中大型股指数上 19.2 ，中型

股指数上 14.3，小型股指数 6.7。由于根据重配比基金，益港股的同开了。

分上半年指数上原，主要有以原：一中国经增在经了年续之在2016年行明并和经一起共复二之前有产、务和人值等被过分大三通的完港股的值不被正，内资金情续。

来，上半年资金续港股，内资金上月资金主力，其中一度港股通月现净，资金对二度港股通续现净，与之前比有不同。港股不新，月份港股通净量开，比大230。一方，一度过港股通金额较，二度月份港股通计净比增一，94。目前，交金额来，港股通交金额续大于港股通，二者分别比81和19。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

止2017年6月30日，本基金份额净值1.124，份额计净值1.124，报告期内本基金净值增长率11.84，同期业绩比较基准17.00。基准主要由于期间人港值3.06，以及一度正基金期未出现了大上，者的在年二度已经完。

4.5 管理人对经、证券及行业的简要

2017年半年，目前整个港股值已来了均值以上的，续上行力大。由于港股与股性较，半年股的主要风险来自于策实以及表，意国整经数据续。半年续整利，港股续上行的性会大一方，港股的续上有于资金的定，由于指已连续上一个月，计第三度整的性较大，但度应在合理之内。

4.6 管理人对报告期内基金值等事的说明

根据中国证券管理会2008年9月12日发的200838文于进一规证券投资基金值业务的指导意，长信基金管理有限责任公司以简称公司了、有效的值策和，立了值作小组，小组由基金事务、投资、交易

等业务负责人以及基金事务至一业务共同组。与人有的
 证券行业作经，法规和值方法。基金经理不与值决策，基金经理
 证券有更的证券值方法，以公司值作小组对证券进行。值决策
 由与会值作小组 12 以上数通过。对于值策，公司与基金托管人分通，
 一意。审计本基金的会计事务所公司基金值策和的性。
 与值方不存在任重大利益。报告期内，未签与值的定务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据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运作情况，本基
 金本报告期有进行利润分配。

本基金收益分配原则：

- 1、在合有基金分的前提下，本基金年收益分配数最 12，基金合
 同生效不 3 个月不进行收益分配
- 2、本基金收益分配方式分：现金分与利投资，投资者现金利或现金
 利自动基金份额进行投资投资者不，本基金收益分配方式现金分
- 3、基金收益分配基金份额净值不于值基金收益分配基准日的基金份额净值
 基金份额收益分配金额不于值
- 4、一基金份额有同等分配
- 5、法律法规或管有规定的，其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金有人数或基金资产净值情的说明

。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人 规 信情况 明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司 以 称 本托管人 在长信上证港股通指数型发起式证券投资基金 以 称 本基金 的托管过 中，严格 中 人 中华人民共和国证券投资基金法 及其 有 法律法规、基金合同和托管 的有 规定，不存在 基金份额 有人利益的行 ，完 尽 尽责 行了应尽的 务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作 规 信、净值计 、利润分配等情况的说 明

本报告期内，本托管人根据 中 人 中华人民共和国证券投资基金法 及其 有 法律法规、基金合同和托管 的规定，对本基金管理人的投资运作进行了 要的 ，对基金资产净值的计 、基金份额 格的计 以及基金 用开 等方 进行了 真的复核，未发现本基金管理人存在 基金份额 有人利益的行 。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信 等内容的真实、准确和完整发表意

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告 ：财务会计报告中的 金 风险及管理 分未在托管人复核 内 、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告 未经审计

6.1 资产 表

会计主 体：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

报告 截止日：2017 年 6 月 30 日

：人

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
行存	1,466,010.72	7,991,168.17
金		
存出保证金		603,180.37
交易性金 资产	19,354,106.56	11,325,292.68
其中：股 投资	19,354,106.56	11,325,292.68
基金投资		
券投资		
资产 证券投资		
金 投资		
生金 资产		
金 资产		
应收证券		
应收利	751.77	6,934.90
应收股利	145,361.69	
应收	18,646.96	
所 资产		
其 资产	48,988.64	
资产总计	21,033,866.34	19,926,576.12
和所有者 益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
：		
期		
交易性金		
生金		
出 金 资产		
应 证券	4.29	2,646,575.98
应	414,313.14	
应 管理人报	13,829.20	5,972.00
应 托管	3,457.29	1,493.00
应 务		
应 交易 用	640.49	4,458.98

应交		
应 利		
应 利润		
所		
其	161,685.79	81,195.65
合计	593,930.20	2,739,695.61
所有者 益:		
实收基金	18,191,630.58	17,101,684.96
未分配利润	2,248,305.56	85,195.55
所有者 益合计	20,439,936.14	17,186,880.51
和所有者 益总计	21,033,866.34	19,926,576.12

：1、报告 止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.124 ，基金份额总额 18,191,630.58 份。

2、本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表 均 同期对比数据。

6.2 利润表

会计主 ：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

：人

目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收	2,354,064.34
1.利 收	22,913.63
其中：存 利 收	22,913.63
券利 收	
资产 证券利 收	
金 资产收	
其 利 收	
2.投资收益 以 -	499,346.23
其中：股 投资收益	186,966.85
基金投资收益	
券投资收益	
资产 证券投资收益	
金 投资收益	
生 收益	
股利收益	312,379.38
3.公 值 动收益 以 -	1,820,332.35
4. 收益 以 -	

5.其收以 -	11,472.13
：二、用	276,088.62
1 管理人报	75,855.03
2 托管	18,963.78
3 务	
4 交易用	22,634.04
5 利出	
其中：出金融资产出	
6 其用	158,635.77
三、利润总额 总额以	2,077,975.72
：所用	
、净利润 净以	2,077,975.72

：本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表均同
期对比数据。

6.3 所有者 益 基金净值 动表

会计主：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

：人

目	本期 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 益合计
一、期所有者 益 基金净值	17,101,684.96	85,195.55	17,186,880.51
二、本期经 动产生 的基金净值 动数 本 期利润		2,077,975.72	2,077,975.72
三、本期基金份额交易 产生的基金净值 动数 净值 以 -	1,089,945.62	85,134.29	1,175,079.91
其中：1.基金	9,558,022.20	792,275.02	10,350,297.22
2.基金	8,468,076.58	707,140.73	9,175,217.31
、本期 基金份额 有人分配利润产生的基 金净值 动 净值 以 -			
、期末所有者 益	18,191,630.58	2,248,305.56	20,439,936.14

基金净值			
------	--	--	--

：本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表均同期对比数据。

报表 财务报表的组 分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由 责人签 ：

基金管理人 责人 主管会计 作 责人 会计 责人

6.4 报表

6.4.1 基金基本情况

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金 以 简称 本基金 经中国证券 管理 会 以 简称 中国证 会 于准 长信上证港股通指数型发起式证券投资基金 的 复 证 2015 2801 准 ，由长信基金管理有限责任公司 中 人 共和 国证券投资基金法 等 法规、2016 年 6 月 28 日中国证 会证券基金 管 于长信 上证港股通指数型发起式证券投资基金 期募 的 2016 1461 和 长信上证港股通指数型发起式证券投资基金基金合同 发 ，基金合同于 2016 年 12 月 15 日 生效。本基金 契约型开放式、发起式，存续期限不定。本基金的基金管理人 长信基金管理有 限责任公司，基金托管人 国泰君安证券股份有限公司。

基金于 2016 年 11 月 28 日至 2016 年 12 月 9 日募 ，募 资金总额人 17,097,521.45 ，利 份额人 4,163.51 ，募 规 17,101,684.96 份。上述募 资金已由 会计 事务所 通合 证，并出 了 字第 1600908 资报告。

根据 中 人 共和国证券投资基金法 及其配 规则、长信上证港股通指数型发起式证 券投资基金基金合同 和 长信上证港股通指数型发起式证券投资基金招募说明书 的有 规 定，本基金的投资 有 动性的金 ，以上证港股通指数的 份股及其 份 股 主要投资对 。更 实现投资目标，本基金 量投资于 行存 、 券、 券 、 证、资产 证券、 以及法律法规或中国证 会 本基金投资的其 金 但 合中国证 会的 规定 。 法律法规或 管 以 基金投资其 品 ，基金管理人在 行 ， 以 其 投资 。

基金的投资组合比例：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于上证港股通指数成份股和港股成份股的资产不低于现金基金资产的 90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的债券的比例不高于基金资产净值的 5%。

法律法规或中国证监会调整投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：95% 上证港股通指数收益率 + 5% 同期银行定期存款利率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则的要求，同时按照中国证监会公告〔2010〕5 号《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 企业会计准则及其有关规定

本财务报表按照企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，财务报表用的记账本位币为人民币。本基金记账本位币的折算依据主要业务收支的记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在确定金融资产或金融负债的目的时，金融资产和金融负债的不同类别：以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、有至到期投资、可供出售金融资产和金融负债。本基金现金金融资产分有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现金金融负债以公允价值计量其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股权投资和债券投资均以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的确认、续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为金融合同的一方时，于资产负债表内确认。在确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，交易费用计入当期损益；对于其他的金融资产或金融负债，交易费用计入初始确认金额。

确认时，金融资产和金融负债的续计量：

以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法进行本计量。

以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产用实际利率法进行续计量。

收到金融资产的现金流量的合同权利终止或所有实质上所有的风险和报酬已经转移给买方，且企业不再保留对该金融资产的控制时，终止确认该金融资产。

金融资产整体终止确认时，本基金将终止确认金额的差额计入当期损益：

所转移金融资产的账面价值

减去因转移而收到的对价

减去转移前金融资产公允价值变动计入当期损益的金额，或金融资产部分终止确认时，将部分终止确认金额计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

特别说明，本基金所述原则计量公允价值：

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

本基金公允价值，与者在计量日对资产或进行定的资产况及所在、对资产出或者用的限等，并用在情况用并有利用数据和其信的值。

存在的金其值日的交易格确定公价值值日交易，但最交易日经未发生重大化证券发行未发生证券格的重大事的，最交易日的交易格确定公价值。

存在的金，值日交易最交易日经发生了重大化或证券发行发生了证券格的重大事，投资品的现行及重大化等，整最交易以确定公价值。

金不存在，用与者同被以往实交易格证有性的值确定公价值。

值情况并自交易的方最进行的交易中用的格、实上同的其金的前公价值、现金流量法和期定型等。用值，尽最大度用数，用与本基金定的数。

6.4.4.6 金资产和金

金资产和金在资产表内分别示，有。但，同的，以的净额在资产表内示：

本基金有已确金额的法定利，法定利前行的
本基金计以净额，或同现金资产和金。

6.4.4.7 实收基金

实收基金对发行基金份额所募的总金额在益准金分分的额。由于基金份额分起的实收基金份额动于基金份额分日根据分前的基金份额数及确定的分比计。由于和起的实收基金份额动分别于基金确日及基金确日。上述和分别基金所起的基金的实收基金增和出基金的实收基金。

6.4.4.8 益准金

益准金核在基金份额发生动，、、出及利投资等中的未分配利润和公价值动益，已实现益准金和未实现益准金。已实现益准金指根据交易日或中的计未分配的已实现益基金净值比计

的金额。未实现 益 准金指根据交易 日 或 中 的 计未分配的未实现 益 基金净值比 计 的金额。 益 准金于基金 确 日或基金 确 日进行确 和计 量，并于会计期末 额 未分配利润 计 。

6.4.4.9 收 / () 的确 和计量

股 投资收益、 券投资收益和 生 收益 金 资产于 日 交金额与其 本的 差额确 。

股利收益 上 公司 告的分 比 计 的金额 应由上 公司代 代 的个人所 用 的净额确 。

券利 收 券投资的 值与 利率计 的金额 应由发行 券的 业代 代 的个人所 用 的净额确 ，在 券实 有期内 日计提。 同 期一 性 本 的 ，根据其发行 、 期 和发行期限 法 内 利率 ， 日计提 利 收 。 利率与实 利率出现重大差 ， 实 利率计 利 收 。

利 收 出 资金的 间和实 利率计 确定。

金 资产收 期应收或实 收 的金额与 确 金额的差额，在 期内 实 利率法 日确 ， 法与实 利率法确定的收 差 较小的 用 法。

公 值 动收益核 基金 有的 用公 值 式计量的以公 值计量 动计 期 益的金 资产、 生金 资产、以公 值计量 动计 期 益的金 等公 值 动 的应计 期 益的利 或 。

6.4.4.10 用的确 和计量

本基金的管理人报 和托管 在 用 期间 基金合同约定的 率和计 方法 日确 。

本基金的交易 用于进行股 、 券、 证等交易发生 确定的金额确 。

本基金的利 出 资金的本金和 用利率 日计提。

出 金 资产利 出 期应 或实 的金额与 确 金额的差额，在 期 内以实 利率法 日确 ， 法与实 利率法确定的 出差 较小的 用 法。

本基金的其 用 不 值日基金份额净值小数 第 ，发生 计 基金 益 基金份额净值小数 第 的，应 用 或 提的方法， 或 提计 基金 益。

6.4.4.11 基金的收益分配 策

1、在 合有 基金分 的前提 ，本基金 年收益分配 数最 12 ， 基金合

同 生效不 3 个月 不进行收益分配

2、本基金收益分配方式分 ；现金分 与 利 投资，投资者 现金 利或 现金 利自动 基金份额进行 投资 投资者不 ，本基金 的收益分配方式 现金分

3、基金收益分配 基金份额净值不 于 值 基金收益分配基准日的基金份额净值 基金份额收益分配金额 不 于 值

4、 一基金份额 有同等分配

5、法律法规或 管 有规定的， 其规定。

6.4.4.12 分 报告

本基金以内 组 、管理要求、内 报告 度 据确定经 分 ，以经 分 基 确定报告分 。

本基金目前以一个经 分 运作，不 要进行分 报告的 。

6.4.4.13 其 重要的会计 策和会计 计

对于证券交易所上 的股 ， 出现重大事 或交易不 的交易不 等情况，本基金根据中国证 会公告 2008 38 于进一 规 证券投资基金 值业务的 指导意 ，根据 情况 用 于发 中基 A A 基金行业股 值指数的通 提 的 指数收益法、 盈率法、现金 量 现法等 值 进行 值。

对于在 定期内的 公开发股 ，根据中国证 会证 会计字 2007 21 于证券 投资基金 行 业会计准则 值业务及份额净值计 有事 的通 以 简称 证券投资 基金 行 业会计准则 值业务及份额净值计 的通 ， 在证券交易所 的同股 的 交易收 于 公开发股 的 投资 本， 值日证券交易所 的同股 的 交易收 值 在证券交易所 的同股 的 交易收 于 公开发股 的 投资 本， 定期内已经过交易所交易 数 定期内总交易所交易 数的比 者之 间差 的一 分确 值增值。

根据 中国证券投资基金业 会 值核 作小组 于 2015 年 1 度 定收益品 的 值 理标准 ，在上 证券交易所、 证券交易所及 行间同业 上 交易或 的 定 收益品 值 理标准 有规定的 ， 用第三方 值 提 的 格数据进行 值。

6.4.5 会计 策和会计 计 更以及差 更正的说明

6.4.5.1 会计 策 更的说明

本基金在本期间未发生重大会计 策 更。

6.4.5.2 会计 计 更的说明

本基金在本期间未发生重大会计 计 更。

6.4.5.3 差 更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差 更正。

6.4.6

根据财 字 1998 55 文 财 、国 务总 于证券投资基金 收 的通 、财 2002128 文 于开放式证券投资基金有 收 的通 、财 2004 78 文 于证券投资基金 收 策的通 、财 2012 85 文 财 、国 务总 、证 会 于实 上 公司股 利差别化个人所 策有 的通 、财 2015 101 财 国 务总 证 会 于上 公司股 利差别化个人所 策有 的通 、财 2005 103 文 于股 分 有 收 策 的通 、上证交字 2008 16 于 整 证券交易 率 作的通 及 证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发 的 证券 交易所 于 证券交易 收方式 整 作的通 、财 2008 1 文 财 、国 务总 于 业所 策的通 、财 2016 36 文 财 、国 务总 于 开 业 增值 的通 、财 2016 140 文 于明确金 、 产开 发、 务等增值 策的通 、财 2017 2 文 于资管产品增值 策有 的通 、财 2017 56 文 务总 于资管产品增值 有 的通 、财 2015 125 文 于内 与 港基金 有 收 策的通 及其 务法规和实务 作, 本基金 用的主要 示 :

以发行基金方式募 资金, 不 于 业 收 , 不 收 业 。

证券投资基金管理人运用基金 股 、 券的差 收 收 业 和 业所 。

自 2016 年 5 月 1 日起, 在 国 内 开 业 增值 以 称 增 值 , 业、 产业、金 业、生 务业等 业 人, , 由 业 增值 。证券投资基金 式证券投资基金, 开放式证券投资基金 管理人运用基

金 股 、 券收 增值 。

对 港 投资者 和个人 通过基金 内 基金份额 增值 。自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人 以 称管理人 运 资管产品过 中发生的增值 应 行 以 称资管产品运 业务 ， 用简易计 方法， 3 的 收率 增值 。

基金作 流通股 在股 分 过 中收 由 流通股 的股份、现金对 ， 收 、 业所 和个人所 。

对基金 的股 的股 、 利收 ， 券的利 收 ，由上 公司、发行 券的 业 在 基金 上述收 代 代 20 的个人所 。自 2013 年 1 月 1 日起，对所 的股 利收 根据 股期限差别化计 个人所 的应 所 额： 股期限在 1 个月以内 1 个 月的，其股 利所 额计 应 所 额 股期限在 1 个月以上至 1 年 1 年的， 50 计 应 所 额 股期限超过 1 年的，股 记日 自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的， 25 计 应 所 额，股 记日在 2015 年 9 月 8 日及以 的， 收个人所 。

于 港 投资者通过基金 内 基金份额的所 ：对 港 投资者 业和个人 通过基金 内 基金份额 的 差 所 ， 收所 。对 港 投资者 业和个人 通过基金 内 基金分配 的收益，由内 上 公 司 内 基金分配股 利 ，对 港 投资者 10 的 率代 所 或发行 券的 业 内 基金分配利 ，对 港 投资者 7 的 率代 所 ，并由内 上 公 司 或发行 券的 业 其主管 务 理 报。内 基金 投资者分配收益 ，不 所 。内 基金管理人应 证券 记 提 内 基金的 港 投资者的 信 。

基金 出股 0.1 的 率 股 交易 ， 股 不 收股 交易 。

对投资者 个人和 投资者 基金分配中 的收 ， 不 收个人所 和 业所 。

6.4.7 方

6.4.7.1 本报告期存在 或其 重大利 的 方发生 化的情况

经长信基金管理有限责任公司股 会审 通过，新增上 投资管理中 有限合 和 上 投资管理中 有限合 基金管理人的股 ，基金管理人已 行 理完

股更事的更记并管，并已于 2017 年 2 月 8 日上述股更事进行公告。

6.4.7.2 本报告期与基金发生交易的方

方称	与本基金的
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人

6.4.8 本报告期及上年度比期间的方交易

6.4.8.1 通过方交易进行的交易

6.4.8.1.1 股交易

金额：人

方称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	交金额	期股 交总额的比
国泰君安证券股份有限公司	14,398,391.18	100.00

：本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效，上年度比期间数据。

6.4.8.1.2 券交易

：本基金本报告期未通过方交易进行券交易。

6.4.8.1.3 券交易

：本基金本报告期未通过方交易进行券交易。

6.4.8.1.4 证交易

：本基金本报告期未通过方交易进行的证交易。

6.4.8.1.5 应方的金

金额：人

方称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	期金	期金 总量的比	期末应 金 额	期末应 金总额的比
国泰君安证 券股份有限 公司	5,759.38	100.00	640.49	100.00

：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效， 上年度 比期间数据。

2、上述 金 格经本基金的基金管理人与对方 确定，以 由中国证券 记
有限责任公司收 的证管 和经手 的净额 示。

根据 证券交易 用 ，本基金管理人在 用国泰君安证券交易 用交易 进行
股 、 券、 证及 交易的同 ， 国泰君安证券 证券 合 务。

6.4.8.2 方报

6.4.8.2.1 基金管理

：人

目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
期发生的基金应 的管理	75,855.03
其中： 的	10,804.00

：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效， 上年度 比期间数据。

2、 基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报 前一日基金资产净值的
0.8 年 率计提， 日 计至 月月 ， 月 。

管理 的计 方法 ： 0.8 年 数

日应计提的基金管理

前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管

：人

目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
期发生的基金应 的托管	18,963.78

：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 15 日起正式生效， 上年度 比期间数据。

2、本基金的托管 前一日基金资产净值的 0.20 的年 率计提， 日计提， 月 。

托管 的计 方法 ： 0.20 年 数

日应计提的基金托管

前一日的基金资产净值。

6.4.8.3 与 方进行 行间同业 的 券()交易

：本基金本报告期末与 方进行 行间同业 的 券 交易。

6.4.8.4 方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用 有资金投资本基金的情况**

份额 : 份

目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
期 有的基金份额	10,001,700.00
期间 总份额	
期间 分 动份额	
: 期间 出总份额	
期末 有的基金份额	10,001,700.00
期末 有的基金份额 基金总份额比	54.98

: 基金管理人运用 有资金投资本基金 率 本基金招募说明书公 的 率 行。

6.4.8.4.2 报告期末 基金管理人 之 的其 方投资本基金的情况

: 本报告期末及上年度末 基金管理人 之 的其 方未投资本基金。

6.4.8.5 由 方保管的 行存 额及 期产生的利 收

: 人

方 称	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末 额	期利 收
国泰君安证券股份有限公司	1,466,010.72	22,425.39

: 本基金通过国泰君安 存于中国 行股份有限公司的 行存 , 于 2017 年 6 月 30 日的
额 人 1,466,010.72 , 应产生的利 收 22,425.39 。

6.4.8.6 本基金在承 期内 与 方承 证券的情况

: 本基金在本报告期末在承 期内 由 方承 的证券。

6.4.8.7 其 交易事 的说明

: 上述 交易均根据正 的 业交易 进行, 并以一 交易 格 定 基 。

6.4.9 期末 2017 年 6 月 30 日 本基金 有的 通 限证券**6.4.9.1 新发/增发证券 于期末 有的 通 限证券**

: 本基金本报告期末未 新发 增发证券 有 通 限的证券。

6.4.9.2 期末 有的 等 通 限 股

：本基金本报告期末未 有 等 通 限 股 。

6.4.9.3 期末 券正 交易中作 的 券

6.4.9.3.1 行间 券正

：本基金本报告期末未 有 行间 券正 交易 作 的 券。

6.4.9.3.2 交易所 券正

：本基金本报告期末未 有 交易所 券正 交易 作 的 券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额：人

	目	金额	基金总资产的 比 %
1	益投资	19,354,106.56	92.01
	其中：股	19,354,106.56	92.01
2	定收益投资		
	其中：券		
	资产 证券		
3	金 投资		
4	金 生品投资		
5	金 资产		
	其中：式 的 金 资产		
6	行存 和 金合计	1,466,010.72	6.97
7	其 资产	213,749.06	1.02
8	合计	21,033,866.34	100.00

：本基金通过 港通交易 投资的港股公 值 19,354,106.56 ， 资产净值比 94.69 ， 本基金未通过 港通交易 投资港股。

7.2 期末 行业分 的股 投资组合

7.2.1 期末指数投资 行业分 的内股 投资组合

：本基金本报告期末未 有 内股 。

7.2.2 期末 投资 行业分 的内股 投资组合

：本基金本报告期末未 有 内股 。

7.2.3 报告期末 行业分 的港股通投资股 投资组合

行业 别	公 值	基金资产净值比
A 基 料	299,584.29	1.47
者 品	1,388,845.60	6.79
者 用品	463,990.03	2.27
	780,459.70	3.82
金	8,465,262.07	41.42
保	439,059.03	2.15
业	1,167,591.08	5.71
信	2,530,242.84	12.38

信 务	953,518.61	4.66
公用事业	1,006,013.02	4.92
产业	1,859,540.29	9.10
合计	19,354,106.56	94.69

：以上分 用 行业标准 。

7.3 期末 公 值 基金资产净值比 大小 的所有股 投资明细

7.3.1 期末指数投资 公 值 基金资产净值比 大小 的前 股 投资明 细

金额 ： 人

	股 代码	股 称	数量 股	公 值	基金资产净 值比
1	00005	股	40,800	2,572,619.03	12.59
2	00700	股	9,300	2,253,606.36	11.03
3	01299	保险	24,600	1,218,064.97	5.96
4	00939	行	197,000	1,034,430.45	5.06
5	01398	行	178,000	814,161.04	3.98
6	00941	中国 动	10,500	755,025.31	3.69
7	00001	长和	7,500	637,921.20	3.12
8	03988	中国 行	171,000	568,426.85	2.78
9	00027		12,000	493,672.90	2.42
10	02888		6,700	457,064.03	2.24

：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股 明细，应阅读 载于长信基金管理有限责任公
司 . . . 的半年度报告正文。

7.3.2 期末 投资 公 值 基金资产净值比 大小 的前 股 投资明 细

：本基金本报告期末未进行 投资。

7.4 报告期内股 投资组合的重大 动

7.4.1 计 金额超出期 基金资产净值 2%或前 20 的股 明细

金额 ： 人

	股 代码	股 称	本期 计 金额	期 基金资产净值比
--	------	-----	---------	-----------

1	00005	股	1,054,265.26	6.13
2	00001	长和	640,499.46	3.73
3	01299	保险	488,005.81	2.84
4	00939	行	482,884.56	2.81
5	00388	港交易所	423,087.44	2.46
6	02888		418,302.38	2.43
7	00700	股	408,536.62	2.38
8	02318	中国安	373,916.59	2.18
9	01398	行	353,438.90	2.06
10	01113	长实产	342,893.43	2.00
11	00016	新基产	303,918.30	1.77
12	00941	中国动	302,789.14	1.76
13	02628	中国人	292,992.45	1.70
14	00688	中国发	256,464.40	1.49
15	03988	中国行	256,252.82	1.49
16	02388	中港	235,803.08	1.37
17	03320	润	215,142.71	1.25
18	00011	生行	198,085.03	1.15
19	00066	港公司	181,184.05	1.05
20	00004		180,751.41	1.05

：本 金额 均 交金额 交 以 交数量 ，不 其 交易 用。

7.4.2 计 出金额超出期 基金资产净值 2%或前 20 的股 明细

金额 ：人

	股 代码	股 称	本期 计 出金额	期 基金资产净值比
1	00005	股	1,347,970.95	7.84
2	01299	保险	627,349.53	3.65
3	00939	行	624,102.04	3.63
4	01398	行	454,212.62	2.64
5	03988	中国行	339,832.08	1.98
6	00656	复国	124,690.87	0.73
7	00151	中国	87,149.64	0.51
8	00288	国	81,453.22	0.47
9	01099	国股	76,448.90	0.44
10	00291	润	62,749.15	0.37

11	01177	中国生	57,585.12	0.34
12	00270	投资	57,496.39	0.33
13	00136		46,994.43	0.27
14	02314	理文	36,414.38	0.21
15	00358	业股份	34,657.55	0.20
16	02899	金业	34,284.88	0.20
17	00867	业	34,231.65	0.20
18	00460		25,731.41	0.15
19	00135		24,489.20	0.14
20	03969	中国通	10,594.24	0.06

：本 出金额 均 交金额 交 以 交数量 ，不 交易 用。

7.4.3 股 的 本总额及 出股 的收 总额

：人

股 本 交 总额	10,209,952.93
出股 收 交 总额	4,188,438.25

：本 股 的 本 交 总额 和 出股 的收 交 总额 均 交金 额 交 以 交数量 ，不 交易 用。

7.5 期末 券品 分 的 券投资组合

：本基金本报告期末未 有 券。

7.6 期末 公 值 基金资产净值比 大小 的前 券投资明细

：本基金本报告期末未 有 券。

7.7 期末 公 值 基金资产净值比 大小 的前 资产 证券投资明细

：本基金本报告期末未 有资产 证券。

7.8 报告期末 公 值 基金资产净值比 大小 的前 金 投资明细

：本基金本报告期末未 有 金 。

7.9 期末公允价值基金资产净值比大小的前证投资明细

：本基金本报告期末未有证。

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和损益明细

：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策略

：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 本期国债期货交易策略

：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和损益明细

：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

：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案或在报告日前一年内公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定股票的情况。

7.12.3 期末其他资产

：人

	称	金额
1	存出保证金	
2	应收证券	
3	应收股利	145,361.69
4	应收利息	751.77
5	应收	18,646.96
6	其他应收	
7	用	48,988.64
8	其他	

9	合计	213,749.06
---	----	------------

7.12.4 期末持有的于股期的券明细

：本基金本报告期末未持有于股期的券。

7.12.5 期末前股中存在通限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前股中存在通限情况的说明

：本基金本报告期末指数投资前股中不存在通限情况。

7.12.5.2 期末投资前股中存在通限情况的说明

：本基金本报告期末未进行投资。

7.12.6 投资组合报告的其文字述分

：由于的原，分之和与合计存在差。

§8 基金份额 有人信

8.1 期末基金份额 有人 数及 有人

份额 : 份

有人 数 ()	均 有的 基金份额	有人			
		投资者		个人投资者	
		有份额	总份 额比	有份额	总份 额比
1,025	17,747.93	10,001,700.00	54.98	8,189,930.58	45.02

8.2 期末基金管理人的 业人 有本基金的情况

目	有份额总数 份	基金总份额比
基金管理人所有 业人 有本基金	42,953.69	0.24

8.3 期末基金管理人的 业人 有本开放式基金份额总量 间的情况

目	有基金份额总量的数量 间 份
本公司 管理人 、基金投资和 责人 有本开放式基金	0
本基金基金经理 有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金 有份额情况

目	有份额总数	有份额 基金总份额 比	发起份额总数	发起份额 基金总份额 比	发起份额承 诺 有期限
基金管理人 有 资金	10,001,700.00	54.98	10,001,700.00	54.98	不 于 3 年
基金管理人 管理人	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金经理等人	0.00	0.00	0.00	0.00	0
基金管理人股	0.00	0.00	0.00	0.00	0
其	0.00	0.00	0.00	0.00	0
合计	10,001,700.00	54.98	10,001,700.00	54.98	不 于 3 年

§9 开放式基金份额 动

：份

基金合同生效日 2016 年 12 月 15 日 基金份额总额	17,101,684.96
本报告期期 基金份额总额	17,101,684.96
本报告期基金总 份额	9,558,022.20
:本报告期基金总 份额	8,468,076.58
本报告期基金 分 动份额 份额 以"-"	
本报告期期末基金份额总额	18,191,630.58

§10 重大事 示

10.1 基金份额 有人大会决

本报告期末 开本基金的基金份额 有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的 基金托管 的重大人事 动

本报告期基金管理人、基金托管人 的基金托管 未发生重大人事 动。

10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

10.4 基金投资策 的

本报告期本基金投资策 未发生 。

10.5 基金进行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未 基金审计的会计 事务所。

10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其 管理人 有 管 或 的情 。

10.7 基金 用证券公司交易 的有 情况

10.7.1 基金 用证券公司交易 进行股 投资及 金 情况

金额 : 人

券 称	交易 数量	股 交易		应 券 的 金	
		交金额	期股 交总额的比	金	期 金 总量的比
国泰君安	2	14,398,391.18	100.00	5,759.38	100.00

: 1、本期 用证券公司交易 的 更情况

本报告期内本基金 用证券公司交易 有 更。

2、 用交易 的 标准和

根据中国证监会于《证券投资基金管理人的通证基金字 1998 29》和《关于完善证券投资基金交易制度有关的通证基金字 2007 48》的有关规定，本公司制定了《用证券公司用交易的标准和》。

1 标准：

- 1 券基本 财务 况、经 况
- 2 券 报告 量、及 性和数量
- 3 券 日信 及 性和有效性
- 4 券 作表现 。

2 ：

根据《用证券公司用交易的标准》券 务 表， 根据 分 进行 基金 用交易 。

§11 投资者决策的其 重要信

11.1 报告期内 一投资者 有基金份额比 或超过 20%的情况

投资者 别	报告期内 有基金份额 化情况					报告期末 有基金情况	
		有基金份 额比 或者超过 20 的 间 间	期 份 额	份 额	份 额	有份 额	份 额 比
	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	10,001,700.00	0.00	0.00	10,001,700.00	54.98
个人							
产品 有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险</p> <p>一 有基金比 过 的投资者连续大量 ， 会 基金投资的 续性和 定性，增 现 本。同 ， 净值计 差 理规则 起基金份额净值 上 或 。</p> <p>2、 期 理的风险</p> <p>一 有基金比 过 的投资者大额 发本基金 额 ， 导 同期中小投资 者小额 分 期 理的情况。</p> <p>3、基金投资策 以实现的风险</p> <p>一 有基金比 过 的投资者大额 ， 起基金资产总净值 ， 基金 在投资 限 ， 导 基金投资策 以实现。</p>							

11.2 投资者决策的其 重要信

本基金本报告期未发生 投资者决策的其 重要信 。

长信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 24 日