

# 长信中证一带一路主题指数分级证券投资 基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 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。

基金托管人广发证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2016 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信中证一带一路指数		
场内简称	带路分级		
基金主代码	502016		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 8 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	广发证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	22,729,828.49 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	长信一带一路 A、长信一带一路 B: 2015 年 8 月 24 日 长信一带一路份额: 2016 年 2 月 1 日		
下属分级基金的基金简称	长信一带一路	长信一带一路 A	长信一带一路 B
下属分级基金场内简称	带路分级	带路 A	带路 B
下属分级基金的交易代码	502016	502017	502018
报告期末下属分级基金份额总额	16,439,210.49 份	3,145,309.00 份	3,145,309.00 份

### 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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证一带一路主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证一带一路主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。长信一带一路份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，

	其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；长信一带一路 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；长信一带一路 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	长信一带一路 预期风险较高、预期收益较高	长信一带一路 A 预期风险低，预期收益低	长信一带一路 B 预期风险高、预期收益高

### 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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王玮
	联系电话	021-61009999	020-87555888-6052
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4007005566	95575
传真		021-61009800	020-87555129

### 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 号时代金融中心 9 楼、 广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 43 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-2,295,425.22
本期利润	-4,441,034.97
加权平均基金份额本期利润	-0.1641
本期基金份额净值增长率	-10.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0655
期末基金资产净值	21,454,533.74
期末基金份额净值	0.944

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。

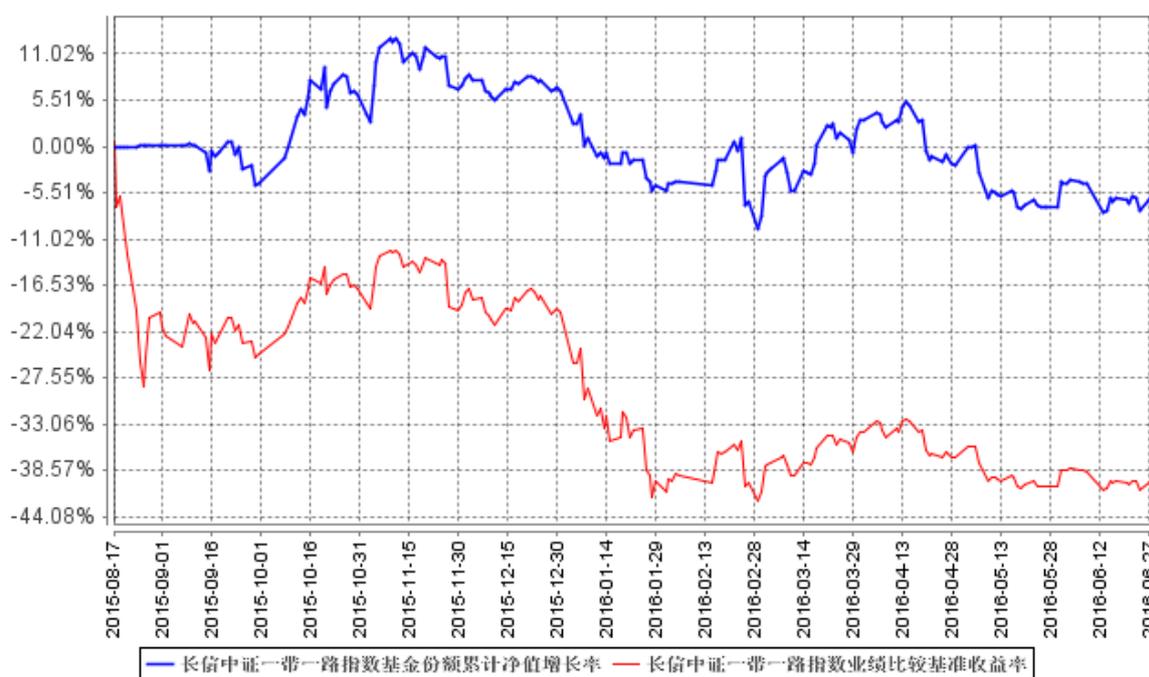
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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
过去一个月	-0.63%	1.12%	-0.80%	1.13%	0.17%	-0.01%
过去三个月	-7.72%	1.21%	-7.59%	1.29%	-0.13%	-0.08%
过去六个月	-10.86%	1.58%	-24.00%	2.24%	13.14%	-0.66%
自基金合同生效起至今	-4.89%	1.48%	-39.07%	2.36%	34.18%	-0.88%

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



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 17 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2015 年 8 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.5 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 49%、上海海欣集团股份有限公司占 34.33%、武汉钢铁股份有限公司占 16.67%。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	本基金、长信量化先锋混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信量化多策略股票基金、长信医疗保健	2015年8月17日	-	6年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员。现任本基金、长信量化先锋混合基金、长信量化中小

	健混合基金 (LOF)、长信利泰混合基金和长信先锐债券基金的基金经理				盘股票基金、长信量化多策略股票基金、长信医疗保健混合基金 (LOF)、长信利泰混合基金和长信先锐债券基金的基金经理。
邓虎	本基金和长信中证能源互联网指数基金 (LOF) 的基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	6 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2015 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，现任本基金和长信中证能源互联网指数基金 (LOF) 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遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同

时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

前期我们对市场的观点是：整个 2016 年上半年市场将维持区间震荡，在整个经济结构转型、经济增长率缓慢爬坡的过程中，中小盘股票的外延扩张将是上市公司中难得的基本面亮点，预计体现在 2016 年业绩上的成长性会明显优于主板股票，从而能获得更好的投资机会。

在经历了 2015 年市场大幅度波动后，出现了 2015 年 4 季度连续三个月的大幅反弹，虽然我们己经意识到较弱的经济基本面难以支撑 2015 年 4 季度以来较大幅度的继续上涨，但 2016 年年初市场的下跌幅度还是超出我们的预期。回顾 2016 年上半年行情，沪深 300 指数涨幅-15.47%，中证 500 指数涨幅-19.61%，创业板指涨幅-17.92%。主要的跌幅就集中在前两个月，后面四个月整个市场维持了震荡向上的格局。大小盘风格在整个区间内并没有分出明显胜负，整个市场风格轮动迅速，周期性较强的大盘股和成长性较强的小盘股在不同阶段都有亮眼的表现。

本基金利用建仓期仓位的灵活性规避了部分风险，本基金 2015 年 12 月 31 日净值为 1.059 元，2016 年 6 月 30 日净值为 0.9440 元，期间净值涨幅-10.86%，同期一带一路指数下跌 25.22%，跌幅小于本基金的跟踪指数。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，带路分级份额净值为 0.944 元，累计份额净值为 0.952 元。本报告期内本基金净值增长率为-10.86%，同期业绩比较基准收益率为-24.00%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年三季度，总体上我们认为，在经历过轮番多次大幅度下跌后、在国内经济 L 型一致预期下、在人民币汇率等风险因素都阶段性形成定论情况下，整个市场的不确定性大幅度降低。

根据估值理论，不确定性降低的重要意义在于意味着投资者风险偏好的上升，从而导致估值

上升。因此我们认为，在没有新的、且重要的风险因素出现的情况下，第三季度的市场乃至整个下半年市场，总体上将形成慢牛行情，结构上、局部上形成牛市行情。2016 年上半年一带一路指数跌幅较多，或在市场回暖之时有一些估值修复。

我们将会保持高仓位，努力控制跟踪误差，为投资者提供工具型产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则如下：

在存续期内，本基金将不进行收益分配（除未来法律法规或监管机构允许的情况外）。本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后的新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### 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 2016 年 4 月 13 日至 2016 年 5 月 11 日，本基金资产净值低于五千万元已持续二十个工作日，截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元，该情形已持续五十四个工作日。

## § 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中证一带一路主题指数分级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，长信中证一带一路主题指数分级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中证一带一路主题指数分级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。

### 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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2016 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,597,654.79	29,370,710.77
结算备付金	-	3,659.71
存出保证金	29,600.01	35,814.71
交易性金融资产	19,214,447.53	23,807,096.60
其中：股票投资	19,214,447.53	23,807,096.60
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收利息	317.96	5,987.17
应收股利	-	-
应收申购款	6,492.21	1,895.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,848,512.50	53,225,164.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	205,692.42	215,903.45
应付管理人报酬	16,778.08	45,836.38
应付托管费	3,691.17	10,084.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,862.04	15,807.49

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	164,955.05	250,813.67
负债合计	393,978.76	538,444.99
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	22,557,357.01	49,389,547.01
未分配利润	-1,102,823.27	3,297,172.29
所有者权益合计	21,454,533.74	52,686,719.30
负债和所有者权益总计	21,848,512.50	53,225,164.29

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，带路分级份额净值 0.944 元，带路 A 份额净值 1.024 元，带路 B 份额净值 0.864 元；基金份额总额 22,729,828.49 份，其中带路分级份额 16,439,210.49 份，带路 A 份额 3,145,309.00 份，带路 B 份额 3,145,309.00 份。

2、本基金本报告期为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-4,115,670.51
1. 利息收入	34,899.88
其中：存款利息收入	32,447.24
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,452.64
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,091,165.97
其中：股票投资收益	-2,222,624.08
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	131,458.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,145,609.75

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	86,205.33
<b>减：二、费用</b>	<b>325,364.46</b>
1. 管理人报酬	132,705.21
2. 托管费	29,195.11
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	64,284.23
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	99,179.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-4,441,034.97</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-4,441,034.97</b>

注：本基金本报告期为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	49,389,547.01	3,297,172.29	52,686,719.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,441,034.97	-4,441,034.97
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）	-26,832,190.00	41,039.41	-26,791,150.59
其中：1. 基金申购款	41,669,349.50	502,163.41	42,171,512.91
2. 基金赎回款	-68,501,539.50	-461,124.00	-68,962,663.50
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）	22,557,357.01	-1,102,823.27	21,454,533.74

注：本基金本报告期为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 6 月 11 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】1212 号文）准予注册，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同》发售，基金合同于 2015 年 8 月 17 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金为股票型证券投资基金，本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）。

本基金于 2015 年 7 月 6 日至 2015 年 8 月 10 日募集，募集资金总额人民币 215,606,836.28 元，利息转份额人民币 61,351.31 元，募集规模为 215,668,187.59 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 1500948 号验资报告。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2015]339 号审核同意，带路 A 份额、带路 B 份额于 2015 年 8 月 24 日在上交所挂牌上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》和《长信中证一带一路主题指数分级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，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本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：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于

标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准： $95\% \times$  中证一带一路主题指数收益率  $+ 5\% \times$  银行人民币活期存款利率（税后）。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 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

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

#### 6.4.5 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券

交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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
广发证券股份有限公司	基金托管人
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

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
广发证券股份有限公司	42,217,412.78	100.00%

注：本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
广发证券股份有限公司	30,000,000.00	100.00%

注：本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	39,317.38	100.00%	2,862.04	100.00%

注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用广发证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从广发证券获得证券研究综合服务。

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	132,705.21
其中：支付销售机构的客户维护费	10,533.59

注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率逐日计提，按月支付。

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

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,195.11

注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率逐日计提，按月支付。

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

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 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固有资金投资本基金的情况

项目	本期			
	2016年1月1日至2016年6月30日			
	长信一带一路	长信一带一路A	长信一带一路B	合计
基金合同生效日持有的基金份额	10,090,331.32	—	—	10,090,331.32
报告期初持有的基金份额	10,090,331.32	—	—	10,090,331.32
报告期间申购/买入总份额	—	—	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
报告期末持有的基金份额	10,090,331.32	—	—	10,090,331.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.39%	—	—	44.39%

注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金管理人运用固有资金投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

#### 6.4.7.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	2,597,654.79	32,447.24

注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金通过广发证券转存于中国建设银行股份有限公司的银行存款，于 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 2,597,654.79 元，相应产生的利息收入为 32,447.24 元。

本基金未通过“广发证券基金托管结算资金专用存款账户”转存结算备付金于中国证券登记结算有限责任公司。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.8 期末（2016 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

本基金报告期末未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002266	浙富控股	2016年5月25日	临时停牌	5.35	-	-	30,700	189,284.88	164,245.00	-
300351	永贵电器	2016年6月29日	临时停牌	33.93	-	-	3,100	72,299.75	105,183.00	-
002207	准油股份	2015年12月16日	临时停牌	21.42	-	-	4,100	61,189.65	87,822.00	-

600545	新疆 城建	2016 年 5 月 31 日	临时 停牌	6.91	-	-	12,000	103,047.59	82,920.00	-
000018	神州 长城	2016 年 6 月 24 日	临时 停牌	12.17	-	-	4,940	51,935.00	60,119.80	-
000582	北部 湾港	2016 年 6 月 7 日	临时 停牌	16.32	-	-	2,300	39,405.92	37,536.00	-

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因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	19,214,447.53	87.94
	其中：股票	19,214,447.53	87.94
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,597,654.79	11.89
7	其他各项资产	36,410.18	0.17
8	合计	21,848,512.50	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,135,061.30	9.95
C	制造业	9,219,615.73	42.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,575,578.00	21.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,825,274.00	13.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	431,851.00	2.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,067.50	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,214,447.53	89.56

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未进行积极投资。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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	600028	中国石化	130,000	613,600.00	2.86
2	601989	中国重工	96,400	610,212.00	2.84
3	601669	中国电建	101,700	580,707.00	2.71
4	000063	中兴通讯	40,200	576,468.00	2.69
5	601668	中国建筑	108,200	575,624.00	2.68
6	601857	中国石油	77,300	558,879.00	2.60
7	601766	中国中车	59,254	543,359.18	2.53
8	601186	中国铁建	54,300	540,828.00	2.52
9	002202	金风科技	34,700	525,011.00	2.45
10	601390	中国中铁	74,600	519,962.00	2.42

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。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未进行积极投资。

## 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	600028	中国石化	755,777.00	1.43
2	601857	中国石油	744,210.00	1.41
3	000063	中兴通讯	706,139.00	1.34
4	601018	宁波港	704,018.08	1.34
5	601668	中国建筑	699,987.00	1.33
6	601989	中国重工	661,468.00	1.26
7	601766	中国中车	636,127.49	1.21
8	601390	中国中铁	628,518.00	1.19
9	601669	中国电建	623,094.00	1.18
10	601186	中国铁建	612,038.00	1.16
11	002202	金风科技	607,845.00	1.15
12	601727	上海电气	559,979.00	1.06
13	600089	特变电工	541,242.38	1.03
14	601618	中国中冶	472,858.00	0.90
15	600118	中国卫星	467,475.00	0.89
16	600406	国电南瑞	456,569.00	0.87
17	000157	中联重科	453,475.00	0.86
18	601866	中海集运	420,733.00	0.80
19	600031	三一重工	408,277.00	0.77
20	601800	中国交建	398,091.00	0.76

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	600028	中国石化	923,320.90	1.75
2	601857	中国石油	891,764.00	1.69
3	601668	中国建筑	836,541.00	1.59
4	000063	中兴通讯	790,291.00	1.50
5	601186	中国铁建	691,470.68	1.31

6	601766	中国中车	667,197.06	1.27
7	601989	中国重工	656,012.41	1.25
8	002202	金风科技	643,467.30	1.22
9	601390	中国中铁	643,005.50	1.22
10	601727	上海电气	603,847.00	1.15
11	601669	中国电建	577,160.40	1.10
12	600089	特变电工	572,250.00	1.09
13	601618	中国中冶	498,830.30	0.95
14	600406	国电南瑞	485,697.80	0.92
15	000157	中联重科	477,634.39	0.91
16	600031	三一重工	466,608.80	0.89
17	600118	中国卫星	444,645.80	0.84
18	600150	中国船舶	423,962.00	0.80
19	600068	葛洲坝	410,996.70	0.78
20	601800	中国交建	403,168.20	0.77

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,996,498.77
卖出股票收入（成交）总额	21,220,914.01

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,600.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	317.96
5	应收申购款	6,492.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,410.18

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有债券。

### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

#### **7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五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**

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
长信一带 一路	1,179	13,943.35	10,090,422.32	61.38%	6,348,788.17	38.62%
长信一带 一路 A	123	25,571.62	253,359.00	8.06%	2,891,950.00	91.94%
长信一带 一路 B	263	11,959.35	33,365.00	1.06%	3,111,944.00	98.94%
合计	1,565	14,523.85	10,377,146.32	45.65%	12,352,682.17	54.35%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

#### 8.2.1 期末上市长信一带一路 A 份额前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	李子韬	350,000.00	11.13%
2	向顺波	173,800.00	5.53%
3	涂筱青	163,208.00	5.19%
4	莫伟南	148,723.00	4.73%
5	李云梅	113,943.00	3.62%
6	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利 3 号资产管理产品	110,000.00	3.50%
7	王皓	102,536.00	3.26%
8	李一平	100,050.00	3.18%
9	德邦基金—招商银行—中泰稳盈回报 1 号资产管理计划	100,000.00	3.18%
10	胡建彬	74,378.00	2.36%

#### 8.2.2 期末上市长信一带一路 B 份额前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
----	-------	----------	----------

1	莫伟南	161,623.00	5.14%
2	李云梅	113,943.00	3.62%
3	刘康安	85,800.00	2.73%
4	钱春	79,900.00	2.54%
5	王灿群	77,000.00	2.45%
6	胡建彬	74,378.00	2.36%
7	刘京	61,453.00	1.95%
8	何建伟	51,400.00	1.63%
9	吕阶富	50,600.00	1.61%
10	谭文汉	49,936.00	1.59%

### 8.3 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	长信一带一路	2,436.14	0.01%
	带路 A	-	-
	带路 B	-	-
	合计	2,436.14	0.01%

### 8.4 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	长信一带一路	0
	长信一带一路 A	0
	长信一带一路 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信一带一路	0
	长信一带一路 A	0
	长信一带一路 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信一带一路	带路 A	带路 B
基金合同生效日（2015 年 8 月 17 日）基金份额总额	215,668,187.59	85,699,609.00	85,699,609.00
本报告期期初基金份额总额	43,852,458.18	2,954,959.00	2,954,959.00
本报告期基金总申购份额	41,967,739.60	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	69,000,287.29	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-380,700.00	190,350.00	190,350.00
本报告期期末基金份额总额	16,439,210.49	3,145,309.00	3,145,309.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

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

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

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

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、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**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券回购交易		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	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	42,217,412.78	100.00%	30,000,000.00	100.00%	39,317.38	100.00%	-

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。

长信基金管理有限责任公司  
2016年8月26日