

长信中证 500 指数增强型证券投资基金 更新的招募说明书摘要

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

长信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 7 月 5 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1119 号文注册募集。基金合同于 2017 年 8 月 30 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券、期货市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，利率风险，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，债券投资出现亏损的风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央

行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等,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的相关规定)。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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2019 年 8 月 30 日,有关财务数据和净值截止日为 2019 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国建设银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

基金管理人概况	
名称	长信基金管理有限责任公司
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼
邮政编码	200120
批准设立机关	中国证券监督管理委员会
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63 号
注册资本	壹亿陆仟伍佰万元人民币
设立日期	2003 年 5 月 9 日
组织形式	有限责任公司
法定代表人	成善栋
电话	021-61009999
传真	021-61009800
联系人	魏明东
存续期间	持续经营

经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
股权结构	股东名称	出资额	出资比例
	长江证券股份有限公司	7350 万元	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	31.21%
	武汉钢铁有限公司	2500.5 万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	751 万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	749 万元	4.54%
	总计	16500 万元	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
成善栋	董事长	男	中共党员，硕士，IMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。
刘元瑞	非独立董事	男	中共党员，硕士，现任长江证券股份有限公司总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
陈谋亮	非独立董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海市湖北商会常务副会长，曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。
何宇城	非独立董事	男	中共党员，硕士，MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师，宝钢资金管理处费用综合管理，宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管，宝钢股份成本管理处综合主管，宝钢股份财务部预算室综合主管，宝钢股份财务部副部长，宝钢分公司炼钢厂副厂长，不锈钢分公司副总经理，宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。
覃波	非独立董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，

	事		具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
徐志刚	独立董事	男	中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
刘斐	独立董事	女	中共党员，工商管理硕士。现任国和创新教育基金（筹）合伙人。曾任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。
马晨光	独立董事	女	致公党党员，法律硕士。现任上海市协力律师事务所律师，管理合伙人，上海市浦东新区人大代表，中国致公党上海市浦东新区副主委，上海市法学会金融法研究会理事，上海国际仲裁中心仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，复旦大学研究生校外导师，华东政法大学校外兼职导师，上海对外经贸大学兼职教授，上海市浦东新区法律服务业协会副会长。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
吴伟	监事会主席	男	中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁有限公司经营财务部部长。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司财务负责人，兼任武汉股权托管交易中心监事长；曾任湖北证券有限公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理、执行副总裁、财务负责人、合规负责人、首席风险官。
杨爱民	监事	男	中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务

			科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001 年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
程燕春	副总经理	男	华中科技大学技术经济学士，具有基金从业资格，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。
安昀	副总经理	男	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。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
宋海岸	基金经理	自 2018 年 2 月 13 日起至 今	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）和长信价值优选混合型证券投资基金的基金经理，现任长信中证 500 指数增强型证券投资基金、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和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
常松	基金经理	自基金合同生效之日起至 2018 年 9 月 8 日	曾任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
安昀	副总经理、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和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
杨帆	国际业务部总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李家春	公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金和长信利富债券型证券投资基金的基金经理

高远	研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理
易利红	股票交易部总监
张文琍	固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金货币市场基金的基金经理
陆莹	现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、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、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理
叶松	权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势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、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
左金保	量化投资部兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信量化先锋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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理
涂世涛	量化专户投资部副总监兼投资经理
秦娟	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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理
李欣	债券交易部副总监
陈言午	专户投资部副总监兼投资经理
卢靖	战略与产品研发部总监
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、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和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理
注：上述人员之间均不存在近亲属关系	

二、基金托管人

(一)、基金托管人情况

(1) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司 (简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

(2) 主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（3）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（二）、基金托管人的内部控制制度

（1）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务

的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（2）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（3）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（1）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（2）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
法定代表人：成善栋	联系人：陈竹君
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
2、场外代销机构	
(1) 交通银行股份有限公司	
注册地址：上海市银城中路 188 号	
办公地址：上海市银城中路 188 号	
	联系人：王菁
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(2) 招商银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
法定代表人：李建红	联系人：季平伟
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(3) 平安银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
法定代表人：孙建一	联系人：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
(4) 中国光大银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心	
办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心	
法定代表人：李晓鹏	联系人：沙牧楠
电话：010-63639110	
客户服务电话：95595	网址：cebbank.com
(5) 长江证券股份有限公司	
注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
法定代表人：李新华	联系人：李良
电话：027-65799999	传真：027-85481900
客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
(6) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼	
办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼	
法定代表人：刘学民	联系人：吴军
电话：0755-23838751	传真：0755-25831754
客户服务电话：95358	网址：www.firstcapital.com.cn
(7) 光大证券股份有限公司	
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
法定代表人：周健男	联系人：龚俊涛
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
(8) 华福证券有限责任公司	
注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	
法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
客户服务电话：95547	网址：www.hfzq.com.cn
(9) 国金证券股份有限公司	
注册地址：成都市东城根上街 95 号	
办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
(10) 国泰君安证券股份有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼	
法人代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
电话：95521	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(11) 平安证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	

法定代表人：何之江	联系人：王阳
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511—8	网址：www.stock.pingan.com
(12) 中泰证券股份有限公司	
注册地址：济南市市中区经七路 86 号	
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
法定代表人：李玮	联系人：秦雨晴
电话：021-20315197	传真：021-20315125
客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn
(13) 申万宏源证券有限公司	
注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	
法定代表人：李梅	联系人：黄莹
电话：021-33389888	传真：021-33388224
客户服务电话：95523 或 4008895523	网址：www.swhysc.com
(14) 天风证券股份有限公司	
注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
办公地址：中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
法定代表人：余磊	联系人：程晓英
电话：18064091773	传真：027-87618863
客服电话：95391 或 400-800-5000	网址：www.tfzq.com
(15) 国融证券股份有限公司	
注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼	
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层	
法定代表人：张智河	联系人：叶密林
电话：010-83991719	传真：010-66412537
客户服务电话：95385	网址：www.grzq.com
(16) 兴业证券股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 268 号	
办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号	
法定代表人：杨华辉	联系人：乔琳雪
电话：021-38565547	
客户服务电话：95562	网址：www.xyzq.com.cn
(17) 中国银河证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层	
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
法定代表人：陈共炎	联系人：辛国政

电话：010-83574507	传真：010-83574807
客户服务电话：4008-888-888 或 95551	网址：www.chinastock.com.cn
(18) 中信证券股份有限公司	
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦	
法定代表人：王东明	联系人：侯艳红
电话：010-60838888	传真：010-60833739
客户服务电话：95558	网址：www.citics.com
(19) 中信证券（山东）有限责任公司	
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	
办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层	
法定代表人：姜晓林	联系人：焦刚
电话：0531-89606166	传真：0532-85022605
客户服务电话：95548	网址：http://sd.citics.com/
(20) 信达证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
法定代表人：张志刚	联系人：鹿馨方
电话：010-63081000	传真：010-63080978
客服热线：95321	网址：www.cindasc.com
(21) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	
注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
法定代表人：祖国明	联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
(22) 上海好买基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室	
法定代表人：杨文斌	联系人：徐超逸
电话：021-20613988	传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
(23) 上海天天基金销售有限公司	
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦	
法定代表人：其实	联系人：朱钰
电话：021-54509998	传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
(24) 大泰金石基金销售有限公司	
注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室	
办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼	
法定代表人：袁顾明	联系人：朱真卿
电话：021-22267943	传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266	网址：www.dtfunds.com
(25) 上海联泰基金销售有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼	
法定代表人：燕斌	联系人：陈东
电话：021-52822063	传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788	网址：www.66zichan.com
(26) 珠海盈米基金销售有限公司	
注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203	
法定代表人：肖雯	联系人：邱湘湘
电话：020-89629099	传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066	网站：www.yingmi.cn
(27) 北京汇成基金销售有限公司	
注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号	
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层	
法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
电话：010-56282140	传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059	网站：www.hcjjin.com
(28) 嘉实财富管理有限公司	
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元	
办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层	
法定代表人：赵学军	联系人：王宫
电话：021-38789658	传真：021-68880023
客户服务电话：400-600-8800	网站：www.jsfund.cn
(29) 北京蛋卷基金销售有限公司	
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507	
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507	
法定代表人：钟斐斐	联系人：侯芳芳
电话：010-61840688	传真：010-84997571
客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanapp.com

(30) 上海基煜基金销售有限公司	
注册地址: 上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济展发区)	
办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室	
法定代表人: 王翔	联系人: 张巍婧
电话: 021-65370077-255	传真: 021-55085991
客户服务电话: 400-820-5369	网站: www.jiyufund.com.cn
(31) 开源证券股份有限公司	
注册地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
办公地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
法定代表人: 李刚	联系人: 袁伟涛
电话: 029-88447611	传真: 029-88447611
客户服务电话: 95325 或 400-860-8866	网站: www.kysec.cn
(32) 华鑫证券有限责任公司	
注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元	
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号	
法定代表人: 俞洋	联系人: 杨莉娟
电话: 021-54967552	传真: 021-54967293
客户服务电话: 95323	网站: www.cfsc.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并在基金管理人网站公示。

(二) 其他相关机构

信息类型	登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
法定代表人	周明	廖海 (负责人)	曾顺福
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-61418888
传真	010-59378907	021-51150398	021-61411909
联系人	崔巍	刘佳、姜亚萍	曾浩 (曾浩、吴凌志为经办注册会计师)

四、基金的名称

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金，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 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围

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（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等，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的相关规定）。

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：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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（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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

八、基金的投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。

1、资产配置策略

本基金为股票指数增强型证券投资基金,投资股票的资产不低于基金资产的 80%,其中,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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。大类资产配置不作为本基金的核心策略,一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出合适调整。

2、股票投资策略

本基金作为股票指数增强型证券投资基金,股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略,通过复制目标股票指数作为基本投资组合,然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素,找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子,并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合,最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化,力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。

(1) 标的指数投资策略

指数化被动投资策略参照标的指数的成分股、备选成分股及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

(2) 量化增强策略

量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,产出投资组合,以追求超越标的指数表现的业绩水平。

多因子超额收益模型:本模型是基于市场不完全有效的假设,着眼于运用统计方法和金融理论发现证券预期收益的驱动因子以及他们之间的关系,利用历史数据回测和构建量化投资模型,预测并持有概率统计上有极大可能产生正收益的投资组合。预期收益的驱动因子可以和基本面投资相同或类似,例如市盈率,资本市值,公司所处板块以及证券历史表现等,也可以是动量因子等技术面指标或者交易数量等流动性因子。

风险模型: 该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口, 包括基金规模、资产波动率、行业集中度等, 力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内, 使其收益需要符合指数收益特征。本模型主要通过控制和优化投资组合相对指数在一些风险因子上的偏离度来实现, 常见风险因子如行业因子和基本面因子等。通过调整风险模型, 本模型力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年跟踪误差不得超过 7.75%。

成本模型: 该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本, 调整基金的换手率, 来达到优化投资组合的目的。

(3) 模型的应用与调整

在正常的市场情况下, 本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时, 基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新, 以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时, 本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断, 临时调整各因子类别的具体组成及权重。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响, 进行合理的利率预期, 判断债券市场的基本走势, 制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中, 本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上, 降低跟踪误差。

4、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时, 本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理, 以控制并降低投资组合风险、提高投资效率, 降低跟踪误差, 从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

6、权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资。

本基金将通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对冲和套利等。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为：中证 500 指数

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权，或中证 500 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或者今后法律法规发生变化，证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，按监管部门要求履行适当程序以后变更标的指数、业绩比较基准、基金名称等并及时公告。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则该等变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 9 月复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 6 月 30 日（摘自本基金 2019 年半年报），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	19,935,746.52	92.75
	其中：股票	19,935,746.52	92.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,504,055.12	7.00
8	其他资产	53,992.69	0.25
9	合计	21,493,794.33	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	301,308.00	1.41
B	采矿业	23,658.94	0.11
C	制造业	8,424,500.39	39.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,142,287.00	5.34
E	建筑业	284,359.30	1.33
F	批发和零售业	1,098,953.00	5.14
G	交通运输、仓储和邮政业	610,927.52	2.86
H	住宿和餐饮业	214,368.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	607,335.90	2.84
J	金融业	296,820.28	1.39
K	房地产业	558,231.34	2.61
L	租赁和商务服务业	540,377.10	2.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	647.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,698.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	296,724.00	1.39
S	综合	497,712.00	2.33
	合计	14,899,907.77	69.72

2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	292,270.28	1.37
B	采掘业	583,589.00	2.73
C	制造业	2,641,961.91	12.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,090.76	0.01
E	建筑业	6,488.20	0.03
F	批发和零售业	202,827.15	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	136,606.13	0.64

H	住宿和餐饮业	51,057.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	913,373.00	4.27
J	金融业	4,100.00	0.02
K	房地产业	190,912.00	0.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,710.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,853.32	0.01
S	综合	-	-
	合计	5,035,838.75	23.56

3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

(三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

1、报告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所有股票投资明细

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	002463	沪电股份	30,100	409,962.00	1.92
2	002191	劲嘉股份	25,600	317,696.00	1.49
3	000513	丽珠集团	9,400	312,362.00	1.46
4	002465	海格通信	32,400	309,096.00	1.45
5	600528	中铁工业	26,700	308,919.00	1.45
6	600380	健康元	35,700	308,805.00	1.44
7	601872	招商轮船	70,582	307,737.52	1.44
8	002299	圣农发展	11,900	301,308.00	1.41
9	603806	福斯特	8,200	301,186.00	1.41
10	600026	中远海能	46,100	299,189.00	1.40
11	300115	长盈精密	28,400	297,916.00	1.39
12	000027	深圳能源	47,900	296,980.00	1.39
13	603328	依顿电子	28,900	296,803.00	1.39
14	600642	申能股份	49,200	295,692.00	1.38
15	000878	云南铜业	27,700	294,451.00	1.38
16	000778	新兴铸管	66,100	293,484.00	1.37
17	000600	建投能源	43,800	293,460.00	1.37
18	000156	华数传媒	26,600	292,866.00	1.37
19	600827	百联股份	29,800	292,338.00	1.37

20	600500	中化国际	39,100	292,077.00	1.37
21	000031	大悦城	45,400	291,468.00	1.36
22	002152	广电运通	42,300	289,755.00	1.36
23	000987	越秀金控	32,100	289,542.00	1.35
24	002489	浙江永强	86,600	289,244.00	1.35
25	000061	农产品	53,300	288,886.00	1.35
26	600037	歌华有线	28,100	288,025.00	1.35
27	000012	南玻A	68,970	286,915.20	1.34
28	600633	浙数文化	30,500	285,175.00	1.33
29	000729	燕京啤酒	42,900	284,856.00	1.33
30	600169	太原重工	106,200	283,554.00	1.33
31	000158	常山北明	52,300	283,466.00	1.33
32	600673	东阳光	36,000	282,600.00	1.32
33	002051	中工国际	24,600	282,162.00	1.32
34	002221	东华能源	31,600	272,076.00	1.27
35	002603	以岭药业	23,001	266,351.58	1.25
36	600312	平高电气	34,200	262,998.00	1.23
37	300088	长信科技	51,900	262,614.00	1.23
38	600565	迪马股份	70,100	261,473.00	1.22
39	600329	中新药业	18,100	258,649.00	1.21
40	002344	海宁皮城	53,500	249,310.00	1.17
41	601717	郑煤机	42,900	244,959.00	1.15
42	000543	皖能电力	51,000	240,210.00	1.12
43	600315	上海家化	7,300	227,395.00	1.06
44	600335	国机汽车	32,600	225,592.00	1.06
45	000009	中国宝安	37,600	214,696.00	1.00
46	600754	锦江股份	8,700	214,368.00	1.00
47	600143	金发科技	43,002	210,709.80	0.99
48	603816	顾家家居	6,520	208,118.40	0.97
49	603556	海兴电力	14,700	203,154.00	0.95
50	002251	步步高	24,000	191,280.00	0.89
51	002250	联化科技	16,200	179,658.00	0.84
52	603198	迎驾贡酒	8,900	159,399.00	0.75
53	600993	马应龙	5,700	100,605.00	0.47
54	600151	航天机电	19,300	99,395.00	0.47
55	000930	中粮生化	7,800	58,656.00	0.27
56	000738	航发控制	4,300	57,620.00	0.27
57	002004	华邦健康	10,700	52,002.00	0.24
58	002048	宁波华翔	3,700	40,034.00	0.19
59	002195	二三四五	5,750	22,367.50	0.10
60	300257	开山股份	1,800	19,944.00	0.09
61	000937	冀中能源	5,100	19,686.00	0.09
62	603228	景旺电子	420	16,804.20	0.08
63	002841	视源股份	200	15,502.00	0.07
64	600578	京能电力	4,500	14,580.00	0.07
65	603883	老百姓	200	11,696.00	0.05
66	600978	宜华生活	3,000	11,280.00	0.05
67	002371	北方华创	134	9,279.50	0.04
68	002242	九阳股份	400	8,324.00	0.04

69	603658	安图生物	100	6,836.00	0.03
70	600801	华新水泥	283	5,730.75	0.03
71	002281	光迅科技	200	5,296.00	0.02
72	002353	杰瑞股份	200	4,620.00	0.02
73	002049	紫光国微	100	4,411.00	0.02
74	002399	海普瑞	200	4,198.00	0.02
75	002439	启明星辰	156	4,196.40	0.02
76	600563	法拉电子	100	4,117.00	0.02
77	002444	巨星科技	400	3,992.00	0.02
78	603868	飞科电器	100	3,915.00	0.02
79	601966	玲珑轮胎	200	3,400.00	0.02
80	300383	光环新网	200	3,354.00	0.02
81	002410	广联达	100	3,289.00	0.02
82	600655	豫园股份	400	3,276.00	0.02
83	002690	美亚光电	100	3,260.00	0.02
84	002815	崇达技术	200	3,118.00	0.01
85	600862	中航高科	300	2,697.00	0.01
86	600155	华创阳安	196	2,632.28	0.01
87	000049	德赛电池	100	2,603.00	0.01
88	000581	威孚高科	134	2,487.04	0.01
89	600388	龙净环保	200	2,478.00	0.01
90	300202	聚龙股份	300	2,337.00	0.01
91	600053	九鼎投资	100	2,330.00	0.01
92	601128	常熟银行	300	2,316.00	0.01
93	000960	锡业股份	200	2,234.00	0.01
94	002818	富森美	170	2,181.10	0.01
95	600426	华鲁恒升	128	1,902.08	0.01
96	601801	皖新传媒	300	1,803.00	0.01
97	600737	中粮糖业	200	1,736.00	0.01
98	002128	露天煤业	200	1,730.00	0.01
99	000926	福星股份	246	1,702.32	0.01
100	300244	迪安诊断	100	1,698.00	0.01
101	603025	大豪科技	160	1,638.40	0.01
102	000021	深科技	200	1,626.00	0.01
103	601928	凤凰传媒	200	1,614.00	0.01
104	600623	华谊集团	200	1,528.00	0.01
105	000656	金科股份	234	1,411.02	0.01
106	002110	三钢闽光	150	1,395.00	0.01
107	000598	兴蓉环境	300	1,365.00	0.01
108	300308	中际旭创	40	1,359.60	0.01
109	002434	万里扬	200	1,358.00	0.01
110	000039	中集集团	120	1,281.60	0.01
111	002375	亚厦股份	200	1,182.00	0.01
112	600184	光电股份	101	1,158.47	0.01
113	000970	中科三环	100	1,135.00	0.01
114	600811	东方集团	300	1,116.00	0.01
115	000006	深振业A	200	1,090.00	0.01
116	600458	时代新材	100	1,039.00	0.00
117	002028	思源电气	100	996.00	0.00

118	002390	信邦制药	184	969.68	0.00
119	002093	国脉科技	100	929.00	0.00
120	000089	深圳机场	100	889.00	0.00
121	601880	大连港	400	852.00	0.00
122	600580	卧龙电驱	100	841.00	0.00
123	600611	大众交通	180	837.00	0.00
124	001696	宗申动力	134	834.82	0.00
125	600657	信达地产	200	824.00	0.00
126	000552	靖远煤电	300	813.00	0.00
127	600395	盘江股份	134	791.94	0.00
128	002428	云南锗业	101	770.63	0.00
129	000528	柳 工	104	692.64	0.00
130	600292	远达环保	100	647.00	0.00
131	601168	西部矿业	100	638.00	0.00
132	600751	海航科技	200	636.00	0.00
133	600787	中储股份	100	573.00	0.00
134	002431	棕榈股份	134	529.30	0.00
135	002482	广田集团	100	486.00	0.00
136	600350	山东高速	100	480.00	0.00
137	300039	上海凯宝	100	445.00	0.00
138	300182	捷成股份	100	441.00	0.00
139	600777	新潮能源	200	416.00	0.00
140	600428	中远海特	100	370.00	0.00
141	300026	红日药业	100	345.00	0.00
142	002277	友阿股份	100	338.00	0.00
143	600881	亚泰集团	100	325.00	0.00
144	000667	美好置业	100	263.00	0.00

2、报告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所有股票投资 明细

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	601958	金钼股份	44,600	298,820.00	1.40
2	000623	吉林敖东	17,800	291,742.00	1.37
3	000559	万向钱潮	48,500	290,030.00	1.36
4	600745	闻泰科技	8,700	289,014.00	1.35
5	000630	铜陵有色	117,300	288,558.00	1.35
6	601118	海南橡胶	55,800	287,370.00	1.34
7	600699	均胜电子	13,200	281,952.00	1.32
8	601808	中海油服	29,100	280,233.00	1.31
9	600570	恒生电子	4,030	274,644.50	1.29
10	300033	同花顺	2,100	206,556.00	0.97
11	002441	众业达	24,900	197,706.00	0.93
12	600571	信雅达	20,500	191,060.00	0.89
13	601100	恒立液压	6,000	188,280.00	0.88
14	000046	泛海控股	33,700	188,046.00	0.88

15	002315	焦点科技	10,900	182,139.00	0.85
16	000637	茂化实华	38,100	177,165.00	0.83
17	603118	共进股份	17,700	163,902.00	0.77
18	300200	高盟新材	15,900	150,255.00	0.70
19	300502	新易盛	6,000	147,120.00	0.69
20	601919	中远海控	26,900	135,038.00	0.63
21	000157	中联重科	18,300	109,983.00	0.51
22	002655	共达电声	11,800	93,692.00	0.44
23	000060	中金岭南	15,300	71,757.00	0.34
24	000524	岭南控股	6,100	51,057.00	0.24
25	300277	海联讯	7,200	49,968.00	0.23
26	300206	理邦仪器	5,200	34,996.00	0.16
27	600276	恒瑞医药	180	11,880.00	0.06
28	300567	精测电子	150	7,878.00	0.04
29	300347	泰格医药	100	7,710.00	0.04
30	300552	万集科技	200	5,758.00	0.03
31	000723	美锦能源	500	5,225.00	0.02
32	300531	优博讯	267	4,688.52	0.02
33	600985	淮北矿业	400	4,536.00	0.02
34	002458	益生股份	228	4,448.28	0.02
35	300558	贝达药业	100	4,150.00	0.02
36	601555	东吴证券	400	4,100.00	0.02
37	603368	柳药股份	100	3,288.00	0.02
38	300525	博思软件	150	3,247.50	0.02
39	300009	安科生物	200	3,180.00	0.01
40	603337	杰克股份	145	2,971.05	0.01
41	002653	海思科	200	2,840.00	0.01
42	300285	国瓷材料	150	2,551.50	0.01
43	600820	隧道股份	400	2,524.00	0.01
44	002475	立讯精密	100	2,479.00	0.01
45	601126	四方股份	400	2,392.00	0.01
46	603606	东方电缆	217	1,881.39	0.01
47	601607	上海医药	101	1,833.15	0.01
48	002713	东易日盛	160	1,611.20	0.01
49	600977	中国电影	102	1,597.32	0.01
50	600548	深高速	167	1,568.13	0.01
51	601588	北辰实业	400	1,500.00	0.01
52	002734	利民股份	100	1,496.00	0.01
53	600606	绿地控股	200	1,366.00	0.01
54	000544	中原环保	168	1,271.76	0.01
55	300316	晶盛机电	100	1,269.00	0.01
56	600373	中文传媒	100	1,256.00	0.01
57	000338	潍柴动力	100	1,229.00	0.01

58	603566	普莱柯	100	1,212.00	0.01
59	601231	环旭电子	100	1,205.00	0.01
60	002020	京新药业	100	1,152.00	0.01
61	002705	新宝股份	100	1,150.00	0.01
62	002747	埃斯顿	125	1,098.75	0.01
63	002081	金螳螂	100	1,031.00	0.00
64	002267	陕天然气	100	819.00	0.00
65	600170	上海建工	200	752.00	0.00
66	601996	丰林集团	200	616.00	0.00
67	600512	腾达建设	200	570.00	0.00
68	000898	鞍钢股份	130	492.70	0.00
69	600873	梅花生物	100	479.00	0.00
70	600257	大湖股份	100	452.00	0.00

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

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	601958	金钼股份	537,015.00	2.69
2	000778	新兴铸管	431,858.00	2.16
3	000718	苏宁环球	416,264.00	2.09
4	600026	中远海能	392,852.00	1.97
5	600565	迪马股份	380,136.00	1.91
6	600754	锦江股份	365,256.00	1.83
7	600971	恒源煤电	362,687.00	1.82
8	601872	招商轮船	352,916.00	1.77
9	002191	劲嘉股份	349,561.00	1.75
10	000559	万向钱潮	348,105.00	1.74
11	002004	华邦健康	339,586.00	1.70
12	002441	众业达	338,015.00	1.69
13	603328	依顿电子	337,855.00	1.69
14	600418	江淮汽车	337,846.00	1.69
15	000061	农产品	333,735.00	1.67
16	000157	中联重科	328,753.00	1.65
17	600037	歌华有线	325,972.00	1.63
18	002489	浙江永强	323,968.00	1.62
19	000031	大悦城	323,841.00	1.62

20	000623	吉林敖东	323,005.00	1.62
----	--------	------	------------	------

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。

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	600737	中粮糖业	617,824.00	3.10
2	600977	中国电影	593,005.22	2.97
3	002242	九阳股份	587,068.00	2.94
4	000990	诚志股份	561,608.00	2.81
5	600184	光电股份	551,890.49	2.77
6	600155	华创阳安	522,544.00	2.62
7	300244	迪安诊断	510,443.00	2.56
8	600418	江淮汽车	454,233.00	2.28
9	000021	深科技	447,687.00	2.24
10	000656	金科股份	438,740.22	2.20
11	601966	玲珑轮胎	438,044.00	2.20
12	601958	金钼股份	437,250.00	2.19
13	600971	恒源煤电	426,804.00	2.14
14	601100	恒立液压	420,977.00	2.11
15	002475	立讯精密	414,540.00	2.08
16	600859	王府井	406,082.48	2.04
17	000718	苏宁环球	401,616.00	2.01
18	002690	美亚光电	393,396.00	1.97
19	600565	迪马股份	391,484.00	1.96
20	000158	常山北明	389,965.00	1.95

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。

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	42,785,160.79
卖出股票收入（成交）总额	45,361,539.10

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。

（五）报告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。

(六) 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八) 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。

(九) 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

(十一) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

（十二）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,003.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	320.21
5	应收申购款	43,668.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,992.69

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

（2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资股票中不存在流通受限情况。

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。

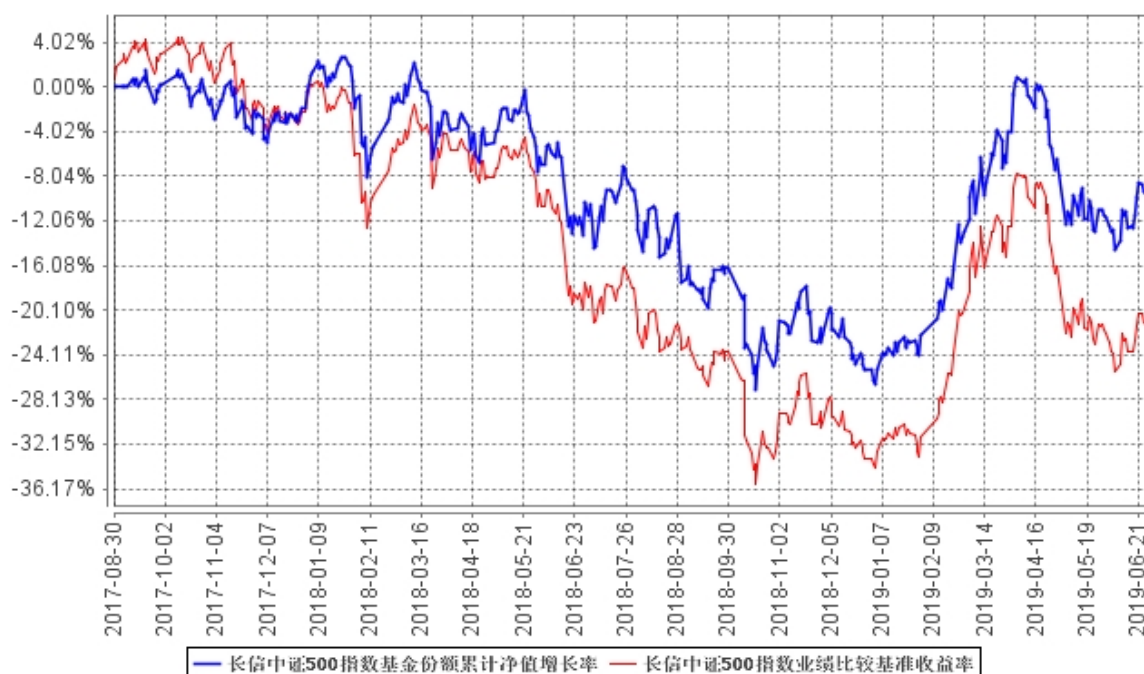
十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）2019年上半年及各历史期间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	净值增长率 ①	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
2017 年 8 月 30 日至 2017 年 12 月 31 日	-1.89%	0.80%	-2.31%	0.86%	0.42%	-0.06%
2018 年	-24.06%	1.43%	-31.85%	1.43%	7.79%	0.00%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	21.58%	1.55%	17.87%	1.70%	3.71%	-0.15%

(二) 自基金合同生效以来基金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 8 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

十三、费用概况

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；

- 3、《基金合同》生效后的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易或结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基

金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3、《基金合同》生效后的指数使用许可费

本基金需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。如上述指数使用许可协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

指数使用许可费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数使用许可费每日计提，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元。指数使用许可费将按照上述指数使用许可协议的约定进行支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（六）申赎费率

1、申购费用

投资者申购本基金时交纳申购费用，申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

单笔申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
$M < 100$ 万	1.5%
$100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	1.0%
$M \geq 500$ 万	1000 元/笔

注：M 为申购金额

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

2、赎回费用

本基金赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

持有期限 (N)	赎回费率
$N < 7$ 日	1.5%
$7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日	0.5%
$30 \text{ 日} \leq N < 1$ 年	0.3%
$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.1%
$N \geq 2$ 年	0%

注：N 为持有期限

3、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回时收取。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归入基金财产的部分用于

支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

6、转换费用

本公司已开通了长信中证 500 指数基金与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信恒利优势混合基金、长信双利优选混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利保债券基金、长信利泰混合基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金 A 类份额（A 类代码：519949）、长信先优债券基金、长信乐信混合基金（非直销渠道）、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金（非直销渠道）、长信价值优选混合基金、长信利率债债券基金、长信合利混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

(1) 投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

(2) 转换份额的计算公式：

非货币基金之间转换

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值

赎回费 = 转出确认金额 × 赎回费率

补差费 = (转出确认金额 - 赎回费) × 补差费率 ÷ (1 + 补差费率)

转入确认金额 = 转出确认金额 - 赎回费 - 补差费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零)

货币基金转至非货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值 + 转出份额对应的未结转收益

补差费 = 转出份额 × 转出基金份额净值 × 补差费率 ÷ (1 + 补差费率)

转入确认金额 = 转出确认金额 - 补差费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 转入基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元，没有赎回费)

非货币基金转至货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值

赎回费 = 转出确认金额 × 赎回费率

转入确认金额 = 转出确认金额 - 赎回费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 货币基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元，补差费为零)

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露

管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其它有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：在“二、释义”“十七、基金的信息披露”等部分，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了相应的内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一九年十二月三十一日