

# 长信金利趋势混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日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

本报告中财务资料未

本报告期 2020 年 1 月 1 日 2020 年 3 月 31 日。

## §2 基金产

基金	长信金利趋势混合
内	长信金利
基金代	1 4
前代	1
代	1 4
基金运作	型
基金合同日	200 年 4 月 30 日
报告期 基金份	3 1 20 4 份
投资标	本基金在有 风险的前提 于 、 业和 个中 趋势的 长的上 公司股 投资， 基金资产的长期 定 值。 本基金 投资的上 公司股 值股和 长 股，股 基于中 趋势 、 和 长 等 的 证。
投资策	本基金 用上 的 投资管理策 ，在 中 长趋势、中 趋势 和资本 发 展趋势的基 上， 于中 趋势 的 长的上 公司证券，以期在风险 的前提 实现投资组合的长期 值。
业绩 基准	上证 A 股指 0 中证 合 指 30
风险	本基金 混合型基金， 于中等风险、中等 的基 金 ，其 期风险和 期 于 基金和 券型基金， 于股 型基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司

基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
-------	----------------

### §3 要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 要财务指标

：人

要财务指标	报告期	2020 年 1 月 1 日	2020 年 3 月 31 日
1 本期 实现			1 02 31
2 本期利			32 24 2
3 基金份 本期利			0 023
4 期 基金资产净值			1 24 2 12
期 基金份 净值			0 1

：1、本期 实现 指基金本期利 、投资 、其 不 公 值

用 的 ，本期利 本期 实现 上本期公 值

2、所述基金业绩指标不 有人 或 基金的 用 ， 基金 金、

基金的 、 利 投资 、基金 等 ， 用 实 要 于所

。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份 净值 长 及其 同期业绩 基准 的

	净值 长	净值 长 标准	业绩 基 准	业绩 基准 标准		
过 个月	3 0	2 04	0	1 22		0 2

### 3.2.2 基金合同 以来基金 净值 长 及其 同期业绩 基准 的



： 1、 示日期 200 年 4 月 30 日 2020 年 3 月 31 日。

2、 基金合同规定，本基金管理人 基金合同 日 个月内 期。 期 ， 本基金的 投资 合基金合同 定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金 理 或基金 理 组

务	任本基金的基金 理期限		证券 业年限	复 大 ， 有基金 业资 。 2014 年 长信基金 管理有限责任公司， 任 发展 ， 现任 发展 、 长信银利 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
	任 日期	任日期		
长信银利 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 理、 发展	201 年 月 31 日		10 年	

					金 理。
--	--	--	--	--	------

：1、任基金 理任 日期以本基金 日 准 或 基金 理的日期根据对  
的公告日期

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的 规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 的

本基金管理人在报告期内， 了 中 人 共和 证券投资基金 及其 有  
规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份 有人 利 ，不存在 基金份 有人利  
的行 。

本基金 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 投资风险的前提 ， 基  
金份 有人 大利 。

## 4.3 公

### 4.3.1 公 的 行

本报告期内，公司 实行公 度，并 公 度 ， 投资决策 ，  
行 的内 ，并 过 作 度、 和 保证公 原则的实现。同  
，公司 过对投资 行的 、 和信 来 对公 过 和 的  
。

### 4.3.2 行 的

本报告期内，完 有 指 的 行投资的组合 ，其 投资组合未发  
所公 同日 的 过 证券 日 的 的 ，未  
发现 行 。

## 4.4 报告期内基金投资策 和运作

### 4.4.1 报告期内基金的投资策 和运作

整 ，2020 年一季度 A 股 现有 有 的 势。期 上证指 3 ， 300  
指 10 02 ，中 指 1 4 ， 业 指 上 4 1 ，中 和 业 的 大于  
300。202 年一季度本基金股 对 。

#### 4.4.2 2020 年 季度 展 和投资策

2020 年 3 月 2 日的中 会 一 重要的会 ， 确保实现决 会 标任务 年 来 个季度定了 。会 财 策要 有 ， 策要 度， 策 的 。

财 策 ， 确了 ：提 财 、 度和发行 别 。其 中，发行 别 过 年来 ， 有重大 ， 了在一季度 大 的 ， 过 的 策 。 策 ， 导利 行， 以 期 利 行， 财 有 信用来 合。

本 会 的定 对 期 有 大的 定海 作用，2 00 大 。 月以来的 整 要 海 内 策 未出，本 会 告了 策 决 并有一 的 。 ， 期 会 业盈利 个 长，对 的基本 。 一 ， 性 的 在 期内不会 ， 一 策 、盈利 的 导 证， 会重 来上 行 。

风 ， 期 股 整 大 要 不 股 于 产业 ，海 度。 ，在海 于 内 策 的 ，行业 ， 重 内 的 、内 型 股和 基 ， 股 的金 产股 作 。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 本基金份 净值 0 1 ，份 净值 2 ，本报告期内本基 金净值 长 3 0 ，同期业绩 基准 0 。

#### 4.6 报告期内基金 有人 或基金资产净值

。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期 基金资产组合

		金	基金 资产的
1	投资	1 33	

	其中：股	1	33	
2	基金投资			
3	定 投资	104	4 10 10	2
	其中：券	104	4 10 10	2
	资产 证券			
4	金 投资			
	金 投资			
	金 资产			
	其中： 的			
	金 资产			
	银行存 和 金合	2	04 31	3 0
	其 资产	1	3 4 4	0 3
	合	1	12 230 01	100 00

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

## 5.2 报告期 行业 的股 投资组合

### 5.2.1 报告期 行业 的 内股 投资组合

代	行业 别	公 值	基金资产净值
A	、 、 、 业		
	业		
	业	3 3 02 1	4 0
	、 、 及 产和 应		
	业		
	发和 业	213 0 2 4	11
	运 、 和 业	0 4 2 32	0 2
	和 业		
	信 、 和信 务业	2 2 23	14 10
	金 业	1 3 1 1 0 00	3
	产业	13 43 3	0
	和 务 务业		
	和 务业	0 2	0 0
	利、 和公共 管理业	4 000 00	0 44
	务、 理和其 务业		
	和 会 作		
	、 和 业		
	合	2 400 041 1	1 1
	合	1 33	1 3

### 5.2.2 报告期 行业 的 股 投资股 投资组合

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

### 5.3 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 股 投资 细

	股 代	股	股	公 值	基金资产净值
1	000002	A	3 00 2	2 34 43 3	0
2	300 2		3 200 000	1 3 000 00	4 4
3	01 33		0 200	13 24 00	3
4	000	发展	1 00 000	0 000 00	3 23
	002 0		1 00 000	2 000 00	3 11
	002 11	中	3 000 20	0 3 00	2
	002	连	20 20	0 2 0	2
	002 24	完	1 000 000	4 0 000 00	2 1
	0003	银行	1 443 00	4 1 0 00	2
10	002		00 000	4 01 000 00	2 2

### 5.4 报告期 券 的 券投资组合

	券	公 值	基金资产净值
1	券		
2	行 据		
3	金 券	1 1 000 00	00
	其中： 策性金	1 1 000 00	00
4	业 券		
	业 期 资券		
	中期 据		
		13 10 10	0
	同业存		
	其		
10	合	104 4 10 10	

### 5.5 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 券投资 细

	券代	券	公 值	基金资产净值	
1	1 030	1 出 0	00 000	0 44 000 00	4 41
2	1100 3	银	122 030	13 10 10	0
3	1 021	1 1	100 000	10 2 000 00	0

**5.6 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 资产 证券投资 细**

：本基金本报告期 未 有资产 证券。

**5.7 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 金 投资 细**

：本基金本报告期 未 有 金 。

**5.8 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 证投资 细**

：本基金本报告期 未 有 证。

**5.9 报告期 本基金投资的股指期货**

**5.9.1 报告期 本基金投资的股指期货 和 细**

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

**5.9.2 本基金投资股指期货 的投资 策**

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

**5.10 报告期 本基金投资的 期**

**5.10.1 本期 期 投资 策**

：本基金本报告期 未投资 期 。

**5.10.2 报告期 本基金投资的 期 和 细**

：本基金本报告期 未投资 期 。

**5.10.3 本期 期 投资**

：本基金本报告期 未投资 期 。

**5.11 投资组合报告**

**5.11.1 本基金投资的前 证券的发行 本期 以及 的 的**

报告期内本基金投资的前 证券的发行 未出现 管 ，或在报告 日 前一年内 公 责、 的 。

**5.11.2 基金投资的前 股 出基金合同规定的 股 的**

本基金投资的前 股 中，不存在 出基金合同规定的 股 的 。

**5.11.3 其 资产**

		金
--	--	---

1	存出保证金		1 404	4
2	应 证券		14	1 3
3	应 股利			
4	应 利		1 20	3 3 33
	应			34 14
	其 应			
	用			
	其			
	合		1 3	4 4

#### 5.11.4 报告期 有的 于 股期的 券 细

	券代	券	公 值	基金资产净值
1	1100 3	银	13 10 10	0

#### 5.11.5 报告期 前 股 中存在 限 的

：本基金本报告期 前 股 中不存在 限 。

#### 5.11.6 投资组合报告 的其 述

：于 的原 ， 和 合 存在 。

## §6 基金份

：份

报告期期 基金份	3 414 1 0
报告期期 基金 份	200 01 4
报告期期 基金 份	4 0 4
报告期期 基金 份 份 以	
报告期期 基金份	3 1 20 4

## §7 基金管理人运用 有资金投资本基金

### 7.1 基金管理人 有本基金份

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用 有资金投资本基金 细

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

## §8 投资者决策的其 重要信

### 8.1 报告期内 一投资者 有基金份 或 过 20%的

：本基金本报告期内未有 一投资者 有基金份 或 过 20 的 。

### 8.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期未发 投资者决策的其 重要信 。

## §9

### 9.1

- 1、中 证 会 准 基金的
- 2、 长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同
- 3、 长信金利趋势混合型证券投资基金
- 4、 长信金利趋势混合型证券投资基金托管  
、报告期内在指定报 上 的 公告的原  
、 上海浦东发展银行证券 资金  
、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及 资 复 。

### 9.2 存

基金管理人的 公 所。

### 9.3 阅

长信基金管理有限责任公司 ； 。

长信基金管理有限责任公司

2020 年 4 月 22 日