长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

2018年第三季度报告

2018年9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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月25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2018年10月23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招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信医疗保健混合（LOF）
场内简称	长信医疗
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月20日
报告期末基金份额总额	93,786,633.90份
投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，并精选医疗保健行业的优质企业进行投资，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-5,856,394.59
2.本期利润	-12,568,484.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1344
4.期末基金资产净值	82,983,386.71
5.期末基金份额净值	0.885

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；

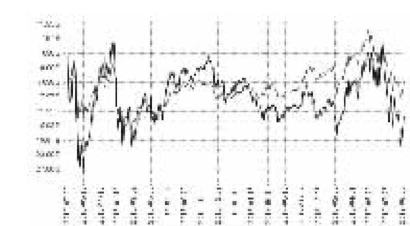
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
过去三个月	-13.06%	2.21%	-7.71%	1.04%	-5.35%	1.17%

3.2.2 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2015年7月20日至2018年9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。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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理，量化投资部总监，投资决策委员会执行委员	2015年7月20日	-	8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。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，现任量化投资部总监和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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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和长信量化多策略股票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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，随着GDP增速回落、地产行业政策收紧、通胀预期升温，宏观经济依旧承压逐渐成为共识。叠加全球贸易格局的改变、美联储持续加息等外在因素，都使得新兴市场国家的货币与资本市场遭遇了较大的冲击，中国也不例外，A股投资者情绪濒临冰点，成交量萎靡，人民币也在持续贬值。在A股整体震荡偏弱的行情下，市场风格向大盘倾斜，银行、部分周期、处于价值洼地的消费类股票更容易受到机构和市场青睐，相反，成长股则遭受了较大的调整。在9月中下旬以后，市场情绪逐渐回暖，大盘呈现出底部反弹走势。三季度医药板块的黑天鹅事件明显增多，疫苗事件、带量采购政策等都为板块带来了明显的冲击，使得整体表现欠佳。

本基金遵循量化投资，使用多因子模型综合考察全市场股票估值、成长性、盈利性及技术层面表现，严格遵照选股模型计算结果进行投资，追求风格分散、持仓个股分散，力争为投资者谋求稳健超额收益。

4.4.2 2018年四季度市场展望和投资策略

展望四季度，虽然宏观经济难有较大起色，但是随着美联储加息空间收紧与全球GDP疲软，中国国内财政政策与货币政策的施展空间将逐步打开。后续值得期待的减税政策和基建投资都将为中国经济注入新的活力。除此之外，A股成功纳入富时罗素指数，新的理财新规放开也将为A股带来非保本理财增量资金，加上目标养老基金入市，这都都将对资本市场产生正面影响。今年以来，主要指数已经承受较大程度的调整，估值悉数降至历史极低位水平，我们认为市场已无大幅下行的条件和空间，因此我们预计未来股市仍将维持目前震荡行情走势，对A股持谨慎乐观的观点，具体到医药领域，重点关注业绩确定性强、优质成长的个股。创新药研发平台；不受政策影响的可选需求；高端医疗器械研发平台；优质医疗服务；业绩逐渐回暖的医药商业都是值得重点关注的投资领域。届时我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日，本基金单位净值为0.885元，份额累计净值为1.425元，本报告期内本基金净值增长率为-13.06%，同期业绩比较基准涨幅为-7.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	76,062,018.69	91.06
	其中：股票	76,062,018.69	91.06
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	7,325,053.85	8.77
8	其他资产	138,761.80	0.17
9	合计	83,525,834.34	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,645,455.69	65.85
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	11,025,107.00	13.29
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	-	-
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	-	-
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	10,391,456.00	12.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,062,018.69	91.66

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	20,300	4,811,100.00	5.80
2	300122	智飞生物	95,400	4,670,784.00	5.63
3	300529	健帆生物	102,400	4,469,760.00	5.39
4	300015	爱尔眼科	133,500	4,305,375.00	5.19
5	000963	华东医药	98,150	4,120,337.00	4.97
6	300347	泰格医药	73,800	3,964,536.00	4.78
7	600436	片仔癀	38,500	3,898,510.00	4.70
8	300003	乐普医疗	121,700	3,693,595.00	4.45
9	600276	恒瑞医药	57,610	3,658,235.00	4.41
10	002422	科伦药业	135,000	3,600,450.00	4.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	27,854.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,594.24
5	应收申购款	109,313.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,761.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	93,359,960.55
报告期期间基金总申购份额	16,200,314.75
减：报告期期间基金总赎回份额	15,773,641.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	93,786,633.90

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；

2、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司

2018年10月25日

长信可转债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月25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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于2018年10月22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招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信可转债债券	
基金主代码	519977	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年3月30日	
报告期末基金份额总额	952,965,883.27份	
投资目标	本基金重点投资于可转换债券（含可分离交易可转债），主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过积极主动的可转债投资管理，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面利用可转债的债券特性，强调投资组合的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性，分享股市上涨产生的较高收益。	
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信可转债债券A	长信可转债债券C
下属分级基金的场内简称	CX转债A	CX转债C
下属分级基金的交易代码	519977	519976
报告期末下属分级基金的份额总额	242,227,258.21份	710,738,625.06份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）	
	长信可转债债券A	长信可转债债券C
1. 本期已实现收益	119,152.24	431,157.01
2. 本期利润	7,371,917.35	23,811,356.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0288	0.0370
4. 期末基金资产净值	300,048,537.44	861,118,673.61
5. 期末基金份额净值	1.2387	1.2116

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 本报告期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

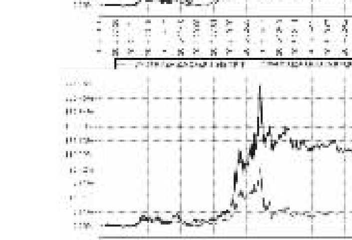
长信可转债债券A

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
过去三个月	2.71%	0.74%	2.03%	0.45%	0.68%	0.29%

长信可转债债券C

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
过去三个月	2.59%	0.74%	2.03%	0.45%	0.56%	0.29%

3.2.2 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2012年3月30日至2018年9月30日。

2、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已符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	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、公司副总经理、投资决策委员会执行委员	2012年3月30日	-	20年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司，加拿大Investors Group Financial Services Co.,Ltd。2002年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利富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、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）和长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度在外部贸易战持续发酵，内部政策边际向好的作用下，权益市场震荡筑底，债券市场分化向上。权益方面，经过6月底的快速回调，7月份反弹动力较足。配合流动性宽松和国常会等政策信号的明朗，金融、基建等板块领涨。8-9月市场在政策落地和风险情绪的释放中，徘徊前进。上半年表现较好的医药、蓝筹等板块乏善可称，相反在风险释放充分后的5G板块，以及行业景气度持续攀升的云计算表现抢眼。到9月底，金融权重以及调整到位的消费板块展开修复行情，稳定市场信心。债券方面，虽然宏观经济下行利好利率下行，但是油价、黑色商品的上涨，以及汇率的贬值趋势又带来下行阻力，整体十年长端利率呈现小幅波动，三年以内短端持续下行，利率曲线牛陡，信用风险见底，但是难言反转。

面对三季度大幅波动的行情，我们提早布局，预判了经济基本面和监管政策对市场的影响，准确把握了机构行为和市场情绪。权益类资产，在判断结构性反弹行情的前提下，集中仓位参与了云计算、5G和自主可控板块，获得超额收益。债券类资产，在短端利率下行和流动性宽松确立的趋势中，加大短端的信用债配置，获得票息和波段操作收益。信用风险方面，优选高等级流动性好的品种，保证组合的稳健盈利。此外，本基金适当配置了部分低估值和正股质地优秀的转债品种，以期获得稳定的投资收益。

4.4.2 2018年四季度市场展望和投资策略

展望2018年四季度，基本面：虽然宏观总量经济下行趋势确立，但是基建逆周期的调节作用、地产开发的持续性有望起到托底作用。价格表现来看，油价上行风险较大，传统CPI继续保持温和态势。

资金面：货币政策偏向适度宽松，去杠杆压力边际改善，流动性整体无忧。

政策方面：基建补短板，加强能源、环保、通信等新型基础设施建设，进一步减税降费，刺激企业和市场活力。

海外方面：全球风险资产波动加大，密切关注美国中期选举结果。

后市策略：等待市场信心的恢复，市场调整的时间和幅度已经较为充分，各项政策正在逐步推进，后续向上改善空间较大。继续挖掘业绩超预期，在下跌中被错杀的品种，重点看好消费、医药、电新、科技等板块的中长期机会。

下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，密切关注经济走势和政策动向，适度调整组合权益部分的行业分布和个股集中度，债券部分的久期和仓位，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长信可转债债券A基金份额净值为1.2387元，份额累计净值为2.1987元，本报告期内长信可转债债券A净值增长率为2.71%；截至本报告期末长信可转债债券C基金份额净值为1.2116元，份额累计净值为2.1186元，本报告期内长信可转债债券C净值增长率为2.59%；同期业绩比较基准收益率为2.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	175,999,834.60	12.80
	其中：股票	175,999,834.60	12.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,093,821,588.86	79.57
	其中：债券	1,093,821,588.86	79.57
	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	99,096,659.69	7.21
8	其他资产	5,755,910.89	0.42
9	合计	1,374,673,994.04	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,487,473.60	5.21
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	-	-
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	115,512,361.00	9.95
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	-	-
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	175,999,834.60	15.16

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	1,014,920	24,439,273.60	2.10
2	300474	景嘉微	440,000	18,537,200.00	1.60
3	600588	用友网络	600,000	16,692,000.00	1.44
4	600570	恒生电子	300,000	16,563,000.00	1.43
5	002609	捷顺科技	2,124,000	15,972,480.00	1.38
6	002153	石基信息	400,000	13,504,000.00	1.16
7	002405	四维图新	700,000	12,845,000.00	1.11
8	300373	扬杰科技	550,000	11,649,000.00	1.00
9	300454	深信服	130,000	10,792,600.00	0.93
10	300348	长亮科技	411,700	10,099,001.00	0.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,374,000.00	7.78
	其中：政策性金融债	90,374,000.00	7.78
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）	1,003,447,588.86	86.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,093,821,588.86	94.20

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	2,906,070	314,901,745.20	27.12
2	113013	国君转债	2,974,460	311,128,516.00	26.79
3	132009	17中油EB	1,479,520	153,130,320.00	13.19
4	132015	18中油EB	1,473,130	147,548,700.80	12.71
5	180201	18国开01	600,000	60,264,000.00	5.19

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	665,984.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,650,494.07
5	应收申购款	439,432.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,755,910.89

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	314,901,745.20	27.12
2	113013	国君转债	311,128,516.00	26.79
3	128024	宁行转债	24,985,400.00	2.15
4	123006	东财转债	14,937,433.56	1.29
5	113504	艾华转债	10,146,376.20	0.87
6	113009	广汽转债	6,123,600.00	0.53
7	110031	航信转债	3,825,285.60	0.33
8	123003	蓝思转债	2,803,800.00	0.24
9	128027	崇达转债	2,155,711.50	0.19
10	113014	林洋转债	916,100.00	0.08
11	128032	双环转债	474,600.00	0.04

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信可转债债券A	长信可转债债券C
报告期期初基金份额总额	214,970,818.64	647,960,371.16
报告期期间基金总申购份额	88,346,286.43	914,087,581.51
减：报告期期间基金总赎回份额	61,089,846.86	851,309,327.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	242,227,258.21	710,738,625.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；

2、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信可转债债券型证券投资基金托管协议》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司

2018年10月25日

长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2018年10月23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招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信国防军工量化混合
基金主代码	002983
交易代码	002983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月5日
报告期末基金份额总额	411,152,075.01份
投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，并精选国防军工行业的优质企业进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。
业绩比较基准	申万国防军工指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-54,565,191.14
2.本期利润	2,984,492.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0053
4.期末基金资产净值	293,004,878.01
5.期末基金份额净值	0.7126

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；

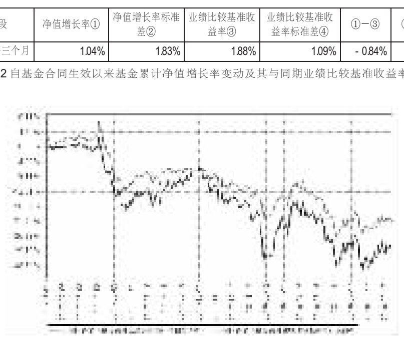
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
过去三个月	1.04%	1.83%	1.88%	1.09%	-0.84%	0.74%

3.2.2 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1月5日至2018年9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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员	2017年1月5日	-	8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。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部总监和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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理。
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、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）和长信先优债券型证券投资基金的基金经理	2018年2月13日	-	4年	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。曾任职于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、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）和长信先优债券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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度上证指数收益率-0.92%，沪深300指数收益率-2.05%，中证500指数收益率-7.99%，创业板指收益率-12.16%。中信国防军工行业收益率4.08%，在29个中信行业中排名5位。

本基金根据股票的基本面情况和市场面情况构建Alpha模型，寻找质地优异、被市场低估的投资标的。综合Alpha模型得分、风险模型、交易成本模型，定期优化组合权重。

4.4.2 2018年四季度市场展望和投资策略

三季度以来，随着GDP增速回落、通胀预期升温、PMI指数临近荣枯线等相继披露，宏观经济依旧承压，且通胀攀升加深未来经济滞涨的预期，叠加中美贸易战、美联储加息预期等外在利空因素，导致A股震荡向下行情。市场风格向大盘倾斜，银行、部分周期、处于价值洼地的消费类股票受到市场青睐，相反，成长股则遭受了较大的调整。但市场主要指数估值均调整至历史低位水平，未来结构性反弹行情可期。

随着军队编制体制改革渐进尾声，订单增长有望迎来补偿性修复，叠加"十三五"规划装备采购前松后紧的规律，军工行业基本面有望明显改善。同时军工领域改革有望步入深水区，军民融合将逐步从量变向质变过渡，改革红利的陆续释放将助力行业快速发展。从中报来看，部分民参军公司回款、订单或业绩增长超预期；而军工集团主机厂及国企零部件总体看也有相应增长，反映了行业的积极变化。军工板块经过两年时间的估值调整，目前估值水平具有吸引力，结构性机会凸显。

我们将自下而上精选有业绩支撑、估值合理的个股，结合数量化组合管理和风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日，本基金份额净值为0.7126元，份额累计净值为0.7126元；本基金本报告期净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益率为1.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	263,834,786.61	89.66
	其中：股票	263,834,786.61	89.66
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	30,136,223.22	10.24
8	其他资产	278,086.05	0.09
9	合计	294,249,095.88	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	250,642,127.64	85.54
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	-	-
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	12,996,113.76	4.44
J	金融业	196,545.21	0.07
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	-	-
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	263,834,786.61	90.04

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300114	中航电测	2,271,620	24,578,928.40	8.39
2	002025	航天电器	881,200	24,127,256.00	8.23
3	600760	中航沈飞	608,900	23,199,090.00	7.92
4	002013	中航机电	2,750,195	23,101,638.00	7.88
5	600038	中直股份	572,786	22,831,249.96	7.79
6	002179	中航光电	511,510	22,506,440.00	7.68
7	000768	中航飞机	970,597	15,413,080.36	5.26
8	600967	内蒙一机	1,090,411	15,091,288.24	5.15
9	002465	海格通信	1,621,800	14,271,840.00	4.87
10	002544	杰赛科技	1,090,278	12,996,113.76	4.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	188,917.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,236.10
5	应收申购款	82,932.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	278,086.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	630,347,443.60
报告期期间基金总申购份额	40,028,370.64
减：报告期期间基金总赎回份额	259,223,739.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	411,152,075.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期末发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；

2、《长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司

2018年10月25日