长信量化多策略股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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，投资者在做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	长信量化多策略股票	
基金主代码	519965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月14日	
报告期末基金份额总额	85,440,339.02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，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。	
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
下属分级基金的场内简称	量化策略A	量化策略C
下属分级基金的交易代码	519965	004858
报告期末下属分级基金的份额总额	85,225,368.55份	214,970.47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）	
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
1. 本期已实现收益	-22,886,958.97	-43,754.23
2. 本期利润	-7,424,805.71	-9,969.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0612	-0.0514
4. 期末基金资产净值	89,678,088.15	223,940.35
5. 期末基金份额净值	1.052	1.042

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

长信量化多策略股票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	-4.97%	1.32%	-6.12%	1.04%	1.15%	0.28%

长信量化多策略股票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	-5.19%	1.32%	-6.12%	1.04%	0.93%	0.28%

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、基金管理人自2017年7月20日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额。

2、长信量化多策略股票A图示日期为2015年7月14日至2018年9月30日，长信量化多策略股票C图示日期为2017年7月20日（份额增加日）至2018年9月30日。

3、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		
常松	曾任本基金的基金经理	2015年9月25日	2018年9月8日	17年	曾任本基金的基金经理
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	2018年8月31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 报告期内基金的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。

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，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

截至本报告期末，长信量化多策略股票A 基金份额净值为1.052元，份额累计净值为1.052元，份额净值增长率为-4.97%；截至本报告期末长信量化多策略股票C基金份额净值为1.042元，份额累计净值为1.042元，份额净值增长率为-5.19%；同期业绩比较基准收益率为-6.12%。

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	82,008,768.07	90.40
	其中：股票	82,008,768.07	90.40
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	8,612,089.65	9.49
8	其他资产	101,441.49	0.11
9	合计	90,722,299.21	100.00

注：本基金本报告期末未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	816,364.00	0.91
B	采矿业	4,513,067.00	5.02
C	制造业	46,622,997.30	51.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	578,035.00	0.64
E	建筑业	2,121,386.75	2.36
F	批发和零售业	1,510,733.60	1.68
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	385,266.00	0.43
J	金融业	19,757,866.24	21.98
K	房地产业	5,703,052.18	6.34
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	82,008,768.07	91.22

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：本基金本报告期末未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	601318	中国平安	58,604	4,014,374.00	4.47
2	600036	招商银行	79,800	2,449,062.00	2.72
3	601899	紫金矿业	589,500	2,104,515.00	2.34
4	601288	农业银行	532,900	2,072,981.00	2.31
5	600030	中信证券	116,700	1,947,723.00	2.17
6	002146	荣盛发展	244,000	1,947,120.00	2.17
7	600741	华域汽车	82,900	1,865,250.00	2.07
8	601988	中国银行	441,700	1,643,124.00	1.83
9	000666	经纬纺机	111,500	1,636,820.00	1.82
10	000651	格力电器	40,638	1,633,647.60	1.82

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	31,609.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,155.61
5	应收申购款	67,676.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,441.49

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000666	经纬纺机	1,636,820.00	1.82	临时停牌

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

项目	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
报告期期初基金份额总额	136,370,158.81	182,730.82
报告期期间基金总申购份额	3,757,277.07	32,239.65
减：报告期期间基金总赎回份额	54,902,067.33	-
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	85,225,368.55	214,970.47

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日至2018年8月28日	37,993,161.09	0.00	37,993,161.09	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

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、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》；

3、《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信量化多策略股票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

长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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	长信富民纯债一年定开债券	
基金主代码	519955	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年9月2日	
报告期末基金份额总额	55,444,759.54份	
投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于业绩比较基准的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。	
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 （1）资产配置策略 （2）类属配置策略 （3）个券选择策略 （4）骑乘策略 （5）息差策略 （6）利差策略 （7）资产支持证券的投资策略 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	固定业绩基准7%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信富民纯债一年定开债券A	长信富民纯债一年定开债券C
下属分级基金的交易代码	005069	519955
报告期末下属分级基金的份额总额	31,377,960.01份	24,066,799.53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）	
	长信富民纯债一年定开债券A	长信富民纯债一年定开债券C
1. 本期已实现收益	-1,153,605.55	-2,510,763.61
2. 本期利润	-563,974.19	-1,321,145.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0121	-0.0138
4. 期末基金资产净值	30,990,278.11	23,760,450.49
5. 期末基金份额净值	0.9876	0.9873

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

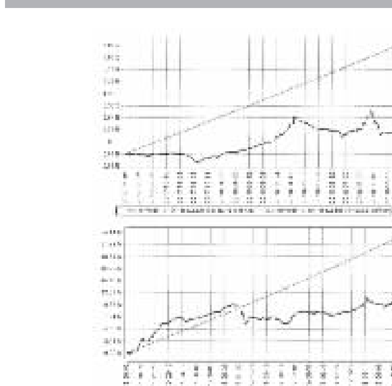
长信富民纯债一年定开债券A

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	-1.14%	0.18%	1.78%	0.02%	-2.92%	0.16%

长信富民纯债一年定开债券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	-1.25%	0.18%	1.78%	0.02%	-3.03%	0.16%

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、基金管理人自2017年8月16日起对长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为C类份额，增设A类份额。

2、长信富民纯债一年定开债券C图示日期为2015年9月2日至2018年9月30日，长信富民纯债一年定开债券A图示日期为2017年8月16日（份额增加日）至2018年9月30日。

3、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		
姜锡峰	长信富泰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、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2017年6月9日	-	7年	管理学硕士，上海财经大学企业管理专业研究生毕业，曾任湘财证券股份有限公司担任债券研究员、浦银安盛基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，2016年5月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、长信利发债券型证券投资基金、长信利泰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和长信先锐债券型证券投资基金的基金经理。现任长信富泰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、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
张文琍	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通货币市场基金的基金经理、固定收益部总监	2016年12月13日	-	24年	高级工商管理硕士，上海财经大学EMBA毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金基金经理职务。现任固定收益部总监、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通货币市场基金的基金经理。

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年前三季度，国内经济增速小幅回落。通胀方面，CPI波动不大；政策方面，央行货币政策由稳健中性转向稳健，多次降低法定准备金率。市场方面，债券收益率总体回落，但高等级债券表现显著好于低等级债券。

报告期内，本基金保持了较稳健的操作策略，并择机参与了债券市场一些波段性的机会。

4.4.2 2018年四季度市场展望和投资策略

四季度经济增速可能会继续回落。考虑到贸易摩擦对进出口的实质影响，预计经济增速会有所回落。货币政策方面，我们预计法定存款准备金率仍会下调。其他政策方面，市场对于宽财政以及宽信用的预期较强，但考虑地方政府债务约束的大背景下，宽松的效果可能有待观察。

综合来看，考虑到基本面和政策面的双向作用，我们预计债券市场收益率仍有下行空间。由于债市收益率曲线较为陡峭，后续可能会呈现长短端平行回落的格局。

从品种方面而言，经济回落背景下，信用债个券信用风险依然较大，信用债标的需要加强个券筛选；下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，进一步优化投资组合，争取为投资人提供安全、稳健的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信富民纯债一年定开债券A份额净值为0.9876元，份额累计净值为1.0132元，本报告期长信富民纯债一年定开债券A净值增长率为-1.14%；长信富民纯债一年定开债券C份额净值为0.9873元，份额累计净值为1.0800元，本报告期长信富民纯债一年定开债券C净值增长率为-1.25%，同期业绩比较基准收益率为1.78%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,376,470.00	68.90
	其中：债券	40,376,470.00	68.90
	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	10,058,135.09	17.16
	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	7,463,718.35	12.74
8	其他资产	699,334.54	1.19
9	合计	58,597,657.98	100.00

注：本基金本报告期末未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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	6,382,270.00	11.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,022,500.00	27.44
	其中：政策性金融债	15,022,500.00	27.44
4	企业债券	18,971,700.00	34.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,376,470.00	73.75

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	010107	21国债（7）	49,750	5,100,370.00	9.32
2	108602	国开1704	50,000	5,032,500.00	9.19
3	018005	国开1701	50,000	5,030,000.00	9.19
4	136851	16华泰G1	50,000	4,976,000.00	9.09
5	180211	18国开11	50,000	4,960,000.00	9.06

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 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,585.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	684,748.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	699,334.54

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	长信富民纯债一年定开债券A	长信富民纯债一年定开债券C
报告期期初基金份额总额	47,460,845.35	98,667,820.93
报告期期间基金总申购份额	31,377,979.30	7,670,379.09
减：报告期期间基金总赎回份额	47,460,864.64	82,271,400.49
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	31,377,960.01	24,066,799.53

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日至2018年9月25日	47,452,735.10	0.00	47,452,735.10	0.00	0.00%
	2	2018年7月1日至2018年9月25日	49,407,114.62	0.00	49,407,114.62	0.00	0.00%
	3	2018年9月26日至2018年9月26日	18,814,229.25	0.00	18,814,229.25	0.00	0.00%
	4	2018年9月26日至2018年9月30日	0.00	16,222,875.68	0.00	16,222,875.68	29.26%
个人	1	2018年9月27日至2018年9月30日	0.00	13,684,618.26	0.00	13,684,618.26	24.68%

产品特有风险

1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

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、《长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信富民纯债一年定期开放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

长信利保债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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	长信利保债券
场内简称	长信利保
基金主代码	519947
交易代码	519947
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月16日
报告期末基金份额总额	49,570,374.98份
投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 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。 2、债券投资策略 本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。 3、股票投资策略 （1）行业配置策略； （2）个股投资策略。 4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。
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	383,787.68
2.本期利润	1,190,373.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0188
4.期末基金资产净值	46,726,493.97
5.期末基金份额净值	0.9426

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	2.90%	0.87%	1.08%	0.01%	1.82%	0.86%

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11月16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		
李小羽	曾任本基金的基金经理	2015年11月16日	2018年7月10日	20年	曾任本基金的基金经理
王夏儒	长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、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和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018年5月29日	-	8年	上海财经大学管理学硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券股份有限公司、华富基金管理有限责任公司、华创证券有限责任公司。2017年加入长信基金管理有限责任公司，曾任职于固收专户投资部，现任职于混合债券部并担任长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、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和长信利盈灵活配置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，在回调中被错杀的品种，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2018年9月30日，本基金份额净值为0.9426元，份额累计净值为0.9426元；本基金本报告期净值增长率为2.90%，同期业绩比较基准收益率为1.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2018年6月25日至2018年8月1日，本基金资产净值低于五千万元已超过二十个工作日。

§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	9,174,610.00	18.90
	其中：股票	9,174,610.00	18.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,737,919.95	77.75
	其中：债券	37,737,919.95	77.75
	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	1,199,475.68	2.47
8	其他资产	426,642.29	0.88
9	合计	48,538,647.92	100.00

注：本基金本报告期末未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	868,700.00	1.86
C	制造业	6,028,630.00	12.90
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	2,277,280.00	4.87
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	9,174,610.00	19.63

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：本基金本报告期末未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	600588	用友网络	55,000	1,530,100.00	3.27
2	002415	海康威视	53,000	1,523,220.00	3.26
3	600196	复星医药	47,000	1,482,850.00	3.17
4	600271	航天信息	42,000	1,168,860.00	2.50
5	000063	中兴通讯	55,000	1,006,500.00	2.15
6	600256	广汇能源	170,000	868,700.00	1.86
7	300373	扬杰科技	40,000	847,200.00	1.81
8	300454	深信服	9,000	747,180.00	1.60

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	2,050,400.00	4.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,066,000.00	19.40
	其中：政策性金融债	9,066,000.00	19.40
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）	26,621,519.95	56.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,737,919.95	80.76

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	018002	国开1302	50,000	5,042,000.00	10.79
2	128024	宁行转债	38,000	4,315,660.00	9.24
3	018005	国开1701	40,000	4,024,000.00	8.61
4	123006	东财转债	32,790	3,780,359.10	8.09
5	123009	星源转债	30,995	3,442,614.65	7.37

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	62,271.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	345,641.31
5	应收申购款	18,729.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	426,642.29

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	128024	宁行转债	4,315,660.00	9.24
2	123006	东财转债	3,780,359.10	8.09
3	123009	星源转债	3,442,614.65	7.37
4	128035	大族转债	3,131,164.80	6.70
5	110031	航信转债	3,078,060.00	6.59

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

报告期期初基金份额总额	48,512,173.98
报告期期间基金总申购份额	43,634,526.70
减：报告期期间基金总赎回份额	42,576,325.70
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	49,570,374.98

§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、《长信利保债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长信利保债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信利保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