长信中证500指数增强型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018年8月29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8月27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2018年1月1日起至2018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500指数
基金主代码	004945
交易代码	004945
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8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
报告期末基金份额总额	78,382,129.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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。 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。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	田青
	联系电话	021-61009999	010-67595096
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4007005566	010-67595096
传真		021-61009800	010-66275853

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9楼、北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-3,186,341.77
本期利润	-1,428,386.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0059
本期基金份额净值增长率	-8.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1045
期末基金资产净值	70,188,995.94
期末基金份额净值	0.8955

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。

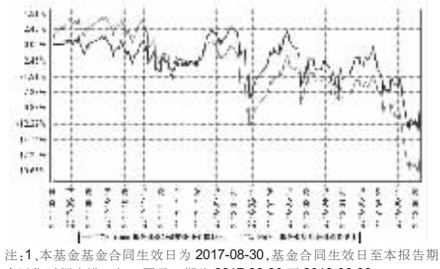
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.33%	1.68%	-8.86%	1.77%	4.53%	-0.09%
过去三个月	-8.44%	1.31%	-13.96%	1.31%	5.52%	0.00%
过去六个月	-8.72%	1.33%	-15.71%	1.37%	6.99%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-10.45%	1.14%	-17.66%	1.19%	7.21%	-0.05%

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2017-08-30,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2017-08-30至2018-06-30。

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1.65亿元人民币。目前股权结构为:长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心(有限合伙)占4.55%、上海彤骏投资管理中心(有限合伙)占4.54%。

截至2018年6月30日,本基金管理人共管理61只开放式基金,即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略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、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置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、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富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、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、长信金葵纯债一年定期开放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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、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、长信富泰纯债一年定期开放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、长信富平纯债一年定期开放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、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证500指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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。

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		
常松	长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势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中证500指数增强型证券投资基金的基金经理、总经理助理、混合策略部总监、投资决策委员会执行委员	2017年8月30日	-	17年	管理学博士,东南大学管理科学与工程专业博士生毕业,具有基金从业资格。曾任富国基金管理有限公司研究员,北京尊嘉资产管理有限公司投资经理,中原证券股份有限公司投资主办,2015年4月加入长信基金管理有限责任公司,现任总经理助理、混合策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势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中证500指数增强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和长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)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和长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。
宋海岸	曾任本基金的基金经理助理	2017年12月4日	2018年2月2日	4年	曾任本基金的基金经理助理

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

2018年上半年上证指数收益率-13.90%、沪深300指数收益率-12.90%,中证500指数收益率-16.53%,创业板指收益率-8.33%。

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,在控制组合跟踪误差的基础上提升组合的收益率。上半年本基金实现收益率-8.72%,同期业绩基准收益率为-15.71%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为0.8955元,份额累计净值为0.8955元,本报告期基金份额净值增长率为-8.72%,同期业绩比较基准收益率为-15.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面,当前中美贸易摩擦增多,房地产融资成本上升、基建投资增速放缓、内需显著回落等因素使得经济增速承压,但我们认为不应对宏观经济过度悲观。一方面中国经济经过各项改革举措会体现出足够的韧性,且"以量换质"的增长方式在日后会释放更多改革红利,另一方面,在更为高频的煤电耗量等数据中我们发现宏观经济有望起底回升。

经过二季度的风险释放,中证500指数估值处于历史底部区域,投资价值凸显。我们将保持稳定的仓位,定期评估估值、成长、盈利质量、分析师预期、技术面等选股因子的表现,继续坚持已有的量化选股模型,结合严格的风险控制,追求持续且稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规,长信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")制订了健全、有效的估值政策和估值程序,成立了估值委员会,估值委员会是公司基金估值的主要决策机构,负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术,健全公司估值决策体系,对公司现有程序和技术进行复核和审阅,当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序;估值委员会成员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,均具备估值业务所需的专业胜任能力,基金经理不直接参与估值决策。对于估值政策和估值原则,公司与基金托管人充分沟通,达成一致意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况,本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下:

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配,具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

无。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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500指数增强型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	6,070,210.35	10,714,655.56
结算备付金	1,697,922.97	10,308,812.17
存出保证金	137,689.93	1,158,167.76
交易性金融资产	62,787,052.05	270,098,862.85
其中:股票投资	62,787,052.05	270,051,219.65
基金投资	-	-
债券投资	-	47,643.20
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	170,733.16	18,040,439.39
应收利息	2,303.91	-944.86
应收股利	-	-
应收申购款	20,583.70	1,007.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	70,886,496.07	310,321,000.36
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
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	8.72	990.51
应付管理人报酬	32,752.10	208,865.34
应付托管费	6,141.01	39,162.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	474,279.23	661,949.53
应交税费	429.73	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	183,889.34	178,094.45
负债合计	697,500.13	1,089,062.10
所有者权益:		
实收基金	78,382,129.69	315,202,169.46
未分配利润	-8,193,133.75	-5,970,231.20
所有者权益合计	70,188,995.94	309,231,938.26
负债和所有者权益总计	70,886,496.07	310,321,000.36

注:1、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.8955元,基金份额总额78,382,129.69份。

2、本基金基金合同于2017年8月30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500指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	1,883,162.72
1.利息收入	134,826.61
其中:存款利息收入	124,670.96
债券利息收入	45.81
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	10,109.84
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-234,775.46
其中:股票投资收益	-2,012,301.00
基金投资收益	-
债券投资收益	1,217.56
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	1,176,322.73
股利收益	599,985.25
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,757,955.13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	225,156.44
减:二、费用	3,311,549.36
1. 管理人报酬	948,145.43
2. 托管费	177,777.29
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,944,995.70
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	3,993.48
7. 其他费用	236,637.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,428,386.64
减:所得税费用	0.00
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,428,386.64

注:本基金基金合同于2017年8月30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500指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	315,202,169.46	-5,970,231.20	309,231,938.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,428,386.64	-1,428,386.64
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)	-236,820,039.77	-794,515.91	-237,614,555.68
其中:1.基金申购款	68,423,812.19	-5,927,137.26	62,496,674.93
2.基金赎回款	-305,243,851.96	5,132,621.35	-300,111,230.61
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)	78,382,129.69	-8,193,133.75	70,188,995.94

注:本基金基金合同于2017年8月30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:

_____成善栋_____ _____覃波_____ _____孙红辉_____

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500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人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》、《长信中证500指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[2017]1119号文批准公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为210,352,867.81份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1700030号的验资报告。基金合同于2017年8月30日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信中证500指数增强型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。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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《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[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入,由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,暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注:本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.6.2 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(以下简称"长信基金")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	基金托管人

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

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期无应付关联方交易单元的佣金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	948,145.43
其中:支付销售机构的客户维护费	2,598.44

注:1、本基金基金合同于2017年8月30日正式生效,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0.80%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法:H=E× 年管理费率÷ 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 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	177,777.29

注:1、本基金基金合同于2017年8月30日正式生效,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0.15%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法:H=E× 年托管费率÷ 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

注:本基金在本报告期未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注:本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	6,070,210.35	80,231.70

注:1、本基金基金合同于2017年8月30日正式生效,无上年度可比期间数据。

2、本基金通过"中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户,于2018年6月30日的相关余额为人民币643,461.76元。(2017年12月31日的相关余额为人民币10,308,812.17元)

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期未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

注: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。本基金非基金中基金,不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.8 期末(2018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

注:本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项	16.60	2018年7月31日	16.50	100,100	1,687,327.00	1,661,660.00	-
002005	德豪润达	2018年1月26日	重大事项	3.77	2018年7月2日	3.92	258,800	1,269,582.50	975,676.00	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项	6.00	-	-	157,500	882,363.41	945,000.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	16.06	-	-	42,500	729,542.00	682,550.00	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项	19.99	2018年7月2日	17.99	13,500	362,610.94	269,865.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项	5.37	-	-	8,400	56,097.97	45,108.00	-
601138	工业富联	2018年6月8日	流通受限	16.40	-	-	17,576	242,021.52	288,246.40	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项	7.21	2018年8月27日	6.47	100	1,092.43	721.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有因交易所市场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	62,787,052.05	88.57
	其中:股票	62,787,052.05	88.57
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	7,768,133.32	10.96
8	其他各项资产	331,310.70	0.47
9	合计	70,886,496.07	100.00

注:本基金本报告期未通过港股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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,549.00	0.00
B	采矿业	2,542,163.20	3.62
C	制造业	33,167,403.64	47.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,462,703.00	3.51
E	建筑业	45,108.00	0.06
F	批发和零售业	4,208,547.00	6.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,263,221.00	3.22
H	住宿和餐饮业	29,568.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,835,995.62	6.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,837,581.00	2.62
L	租赁和商务服务业	1,427,520.00	2.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	269,865.00	0.38
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	1,058,472.00	1.51
S	综合	-	-
	合计	54,149,696.46	77.15

7.2.2 期末积极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