长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司，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。

1.1

1.2

1.3 基金简介

1.4 基金基本情况

基金简称	长信电子信息量化混合
场内简称	信息量化
基金主代码	519929
交易代码	519929
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月27日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	560,605,451.19份
基金合同存续期	不定期

1.5 基金产品说明

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，并精选电子信息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	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、股票投资策略 本基金结合基金管理人量化团队多年定量研究与投资的经验，充分挖掘并不断扩充对市场，对组合构建产生影响的各种因子，并利用定量模式，甄别不同股票未来获取超额收益的可能性，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在控制组合风险的基础上，力求获得超越基准的投资回报。 3、债券投资策略 本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。 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、股指期货等金融工具的投资。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率× 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。

1.6 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	陆志俊
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216

1.7 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	上海浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼，上海市仙霞路18号

§ 2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 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	-69,541,631.90
本期利润	-68,816,786.07
加权平均基金份额本期利润	-0.1225
本期基金份额净值增长率	-14.15%
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	-0.2843
期末基金资产净值	401,215,577.34
期末基金份额净值	0.716

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。

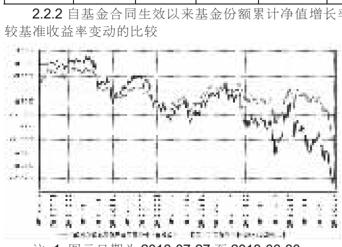
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.2 基金净值表现

2.2.1 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	-5.04%	2.22%	-6.71%	1.40%	1.67%	0.82%
过去三个月	-14.56%	1.77%	-11.67%	1.08%	-2.89%	0.69%
过去六个月	-14.15%	1.78%	-8.41%	1.10%	-5.74%	0.68%
过去一年	-19.37%	1.46%	-9.65%	0.92%	-9.72%	0.54%
自基金合同生效起至今	-28.40%	1.20%	-18.25%	0.79%	-10.15%	0.41%

2.2.2 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、图示日期为2016-07-27至2018-06-30。

2、按基金合同规定，本基金管理人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约定。

§ 3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 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。

3.1.2 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		
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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、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、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、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和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监	2016年7月27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和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。现任量化投资部总监、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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、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、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、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和长信量化价值精选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。

3.2 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。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 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。

3.3.2 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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截止2018年6月30日，长信电子信息行业量化净值为0.716，报告期内基金净值收益率为-14.15%，同期业绩比较基准收益率为-8.41%。

回顾2018年上半年，市场先上涨后回调，风格切换频繁。各主要指数均遭受较大幅下调，调整幅度平均在15%左右，指数估值水平均回归至历史低位，个股涨跌幅中位数-20%左右。大小盘分化方面，年初分化较为明显，大盘蓝筹和中小盘成长股均迎来各自一轮单边上涨行情，进入二季度后期，大盘小盘均经历较大调整，此中分化不甚明显。主题方面，消费板块一枝独秀，成长股板块先涨后跌，其他主题较为乏善可陈。事件方面，诸如独角兽回归、两会召开、贸易战摩擦不断升级、央行去杠杆防风险的持续推进、金融监管不断加强等种种利空因素叠加，加之刚兑打破债务违约常态化以及部分优质股业绩接连爆雷致使市场情绪面较为波动，整体走势较为震荡。

具体到TMT领域，2月下旬，受益于独角兽回归催化优质成长股情绪回暖，成长股开始出现强势反弹，TMT板块一直处于领涨地位。进入二季度后，由于贸易摩擦升级、监管趋严等因素，市场风险偏好下降，TMT持续走弱，上季度获利基本回吐。最终，上证综指回调13.90%，计算机(中信)回调5.42%，电子元器件(中信)回调18.96%，传媒(中信)回调21.06%，通信(中信)回调26.66%，处于行业涨幅中下游水平。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为0.716元，份额累计净值为0.716元，本报告期内本基金份额净值增长率为-14.15%，同期业绩比较基准收益率为-8.41%。

3.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来我们认为，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。市场方面，宏观不确定性因素较多，加之去杠杆、防风险的持续推进，融资成本的上升以及金融监管加强等原因使得当前市场仍处于存量博弈中，市场情绪较为羸弱，交易量低迷，在这种状态下单边上涨行情大概率不会出现。但，市场主要指数估值均调整至历史低位水平，上证综指逼近熔断底部，当前有望成为阶段性低点，加之中报业绩催化，未来结构性反弹行情可期。

具体到TMT领域，中美贸易摩擦升级，连累半导体、通讯等个股遭受大幅调整，我们认为其中业绩优秀质地良好的成长股处于价值洼地中，具有良好的配置价值；除此之外，主题方面，我们看好5G、物联网、云计算、人工智能、医疗信息化等方向，届时这些主题有望成为下一轮成长股行情的催化剂。

我们将致力于寻找具有股价安全边际的优质成长股，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。

3.6 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。

3.7 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，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。

3.8 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。

§ 4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018年度上半年，基金托管人在长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

4.2 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

2018年度上半年，长信基金管理有限责任公司在长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

4.3 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

2018年度上半年，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 5 半年度财务会计报告(未经审计)

5.1 资产负债表

会计主体：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

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		43,808,168.69	23,425,649.60
结算备付金		1,345,085.96	2,934,191.73
存出保证金		122,218.16	257,602.50
交易性金融资产		357,777,107.70	407,866,709.34
其中：股票投资		355,108,090.82	404,277,155.94
基金投资		-	-
债券投资		2,669,016.88	3,589,553.40
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		-	35,213,986.66
应收利息		10,833.27	-5,775.03
应收股利		-	-
应收申购款		4,483.52	18,603.87
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		403,067,897.30	469,710,968.67
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		3,400.21	1,836,041.77
应付赎回款		600,040.19	471,593.94
应付管理人报酬		503,996.19	605,768.50
应付托管费		83,999.38	100,961.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		516,843.74	925,328.32
应交税费		21.24	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		144,019.01	270,843.72
负债合计		1,852,319.96	4,210,537.66
所有者权益：			
实收基金		560,605,451.19	558,292,769.23
未分配利润		-159,389,873.85	-92,792,338.22
所有者权益合计		401,215,577.34	465,500,431.01
负债和所有者权益总计		403,067,897.30	469,710,968.67

注：报告截止日2018-06-30，基金份额净值0.716元，基金份额总额560605451.19份。

5.2 利润表

会计主体：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-62,990,571.33	-35,564,881.72
1.利息收入		250,898.07	448,200.99
其中：存款利息收入		147,687.34	448,200.99
债券利息收入		86,583.34	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,627.39	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-64,048,219.34	-29,984,052.86
其中：股票投资收益		-67,515,854.09	-32,610,059.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益		442,937.71	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,024,697.04	2,626,006.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		724,845.83	-6,164,286.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		81,904.11	135,256.58
减：二、费用		5,826,214.74	8,882,825.51
1. 管理人报酬		3,322,866.97	5,999,950.71
2. 托管费		553,811.20	999,991.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,784,587.60	1,725,934.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15.23	-
7. 其他费用		164,933.74	156,948.74
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-68,816,786.07	-44,447,707.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-68,816,786.07	-44,447,707.23

5.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

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)	558,292,769.23	-92,792,338.22	465,500,431.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-68,816,786.07	-68,816,786.07
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)	2,312,681.96	2,219,250.44	4,531,932.40
其中：1.基金申购款	107,061,698.32	-17,350,953.21	89,710,745.11
2.基金赎回款	-104,749,016.36	19,570,203.65	-85,178,812.71
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)	560,605,451.19	-159,389,873.85	401,215,577.34
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	894,058,293.77	-49,644,350.72	844,413,943.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-44,447,707.23	-44,447,707.23
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)	221,147,063.40	-30,503,996.83	190,643,066.57
其中：1.基金申购款	318,863,693.43	-38,594,411.17	280,269,282.26
2.基金赎回款	-97,716,630.03	8,090,414.34	-89,626,215.69
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)	1,115,205,357.17	-124,596,054.78	990,609,302.39

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

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金(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》、《长信电子信息量化灵活配置混合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[2016]1196号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为891,999,358.96份，经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于2016年7月27日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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《长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的招募说明书》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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于电子信息行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金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)或者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TMT产业主题指数收益率× 60%+ 中证综合债指数收益率× 40%

5.4.2 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。

5.4.3 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、2018年1月1日至2018年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

5.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.4.1 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。

5.4.4.2 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。

5.4.5 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。

5.4.6 关联方关系

5.4.6.1 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

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。

5.4.6.2 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	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司("长江证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

5.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

5.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	209,467,213.39	14.52%	555,166,951.01	41.21%

5.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长江证券	376,029.10	2.35%	-	-

5.4.7.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

5.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

5.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	176,678.53	18.77%	176,678.53	34.18%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	461,512.80	44.38%	306,394.54	87.47%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务

5.4.7.2 关联方报酬

5.4.7.2.1 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,322,866.97	5,999,950.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,478,043.05	2,435,013.37

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值× 1.5%/ 当年天数

5.4.7.2.2 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	553,811.20	999,991.80

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值× 0.25%/ 当年天数

5.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

5.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

5.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

5.4.7.4.2 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。

5.4.7.5 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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	43,808,168.69	135,931.79	172,007,183.18	348,280.10

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于2018年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2017年12月31日：同)

5.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

5.4.7.7 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。

5.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

5.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
601138	工业富联	2018年6月8日	2019年6月8日	新股锁定	13.77	16.40	17,576	242,021.52	288,246.40	-

5.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

5.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.8.3.1 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。

5.4.8.3.2 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。

§ 6 投资组合报告

6.1 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	355,108,090.82	88.10
	其中：股票	355,108,090.82	88.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,669,016.88	0.66
	其中：债券	2,669,016.88	0.66
	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	45,153,254.65	11.20
8	其他各项资产	137,534.95	0.03
9	合计	403,067,897.30	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

6.2 期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	269,073,929.38	67.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,456.00	0.01
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	58,397,472.91	14.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,409,742.39	3.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	14,097,264.00	3.51
S	综合	-	-
	合计	355,108,090.82	88.51

6.2.2 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。

6.3 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

金额单位：人民币元

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	002008	大族激光	316,000	16,808,040.00	4.19
2	002415	海康威视	414,488	15,389,939.44	3.84
3	300296	利亚德	1,159,028	14,928,280.64	3.72
4	002396	星网锐捷	700,050	14,330,023.50	3.57
5	000636	风华高科	890,400	14,139,552.00	3.52
6	300251	光线传媒	1,384,800	14,097,264.00	3.51
7	002376	新北洋	850,733	14,071,123.82	3.51
8	002341	新纶科技	1,039,320	13,812,562.80	3.44
9	600487	亨通光电	624,666	13,773,885.30	3.43
10	002449	国星光电	1,263,470	13,443,320.80	3.35

6.4 注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站(www.cxfund.com.cn)的半年度报告正文。报告期内股票投资组合的重大变动

6.4.1 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	002635	安洁科技	23,874,131.73	5.13
2	603025	大豪科技	19,430,540.63	4.17
3	300115	长盈精密	19,412,253.01	4.17
4	002518	科士达	18,835,589.10	4.05
5	002415	海康威视	18,538,742.34	3.98
6	002056	横店东磁	18,458,119.21	3.97
7	300365	恒华科技	18,421,193.00	3.96
8	300219	鸿利智汇	17,802,406.50	3.82
9	600183	生益科技	16,917,721.87	3.63
10	002241	歌尔股份	16,799,682.00	3.61
11	002396	星网锐捷	16,119,364.00	3.46
12	300207	欣旺达	15,536,639.76	3.34
13	300323	华灿光电	15,073,443.16	3.24
14	002491	通鼎互联	14,860,858.00	3.19
15	300251	光线传媒	14,839,088.00	3.19
16	002341	新纶科技	14,776,835.84	3.17
17	300545	联得装备	14,488,899.93	3.11
18	002587	奥拓电子	13,954,350.76	3.00
19	002376	新北洋	13,828,106.38	2.97
20	002217	合力泰	13,182,329.00	2.83
21	002139	拓邦股份	12,955,529.13	2.78
22	000636	风华高科	12,900,826.00	2.77
23	300476	胜宏科技	12,832,146.60	2.76
24	600703	三安光电	12,686,253.00	2.73
25	603660	苏州科达	12,156,245.35	2.61
26	002555	三七互娱	12,093,631.36	2.60
27	600588	用友网络	11,665,631.70	2.51
28	002456	欧菲科技	11,359,135.84	2.44
29	300438	鹏辉能源	11,285,477.04	2.42
30	002815	崇达技术	11,255,461.02	2.42
31	002402	和而泰	10,967,192.44	2.36
32	600845	宝信软件	10,736,586.63	2.31
33	002624	完美世界	10,706,769.96	2.30
34	300136	信维通信	10,519,955.94	2.26
35	300433	蓝思科技	10,407,225.92	2.24
36	603228	景旺电子	10,295,187.00	2.21
37	002027	分众传媒	10,243,812.13	2.20
38	600667	太极实业	10,168,902.00	2.18
39	300038	梅泰诺	9,777,040.00	2.10

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。

6.4.2 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	600183	生益科技	31,986,179.66	6.87
2	002518	科士达	30,657,255.94	6.59
3	300115	长盈精密	30,603,110.68	6.57
4	300365	恒华科技	25,510,361.26	5.48
5	002236	大华股份	23,660,995.17	5.08
6	002635	安洁科技	22,859,517.00	4.91
7	603025	大豪科技	21,150,400.21	4.54
8	002415	海康威视	19,249,921.48	4.14
9	600563	法拉电子	19,045,440.58	4.09
10	002241	歌尔股份	18,034,710.56	3.87
11	300182	捷成股份	18,022,446.15	3.87
12	002624	完美世界	17,863,719.00	3.84
13	002056	横店东磁	17,070,859.38	3.67
14	000413	东旭光电	16,516,500.00	3.55
15	300438	鹏辉能源	15,711,301.96	3.38
16	002027	分众传媒	15,439,458.15	3.32
17	002456	欧菲科技	15,183,051.83	3.26
18	300323	华灿光电	13,348,887.00	2.87
19	000049	德赛电池	12,789,118.98	2.75
20	600271	航天信息	12,597,837.70	2.71
21	600667	太极实业	12,174,072.00	2.62
22	002555	三七互娱	11,638,274.12	2.50
23	002195	二三四五	11,136,694.00	2.39
24	603228	景旺电子	10,969,213.84	2.36
25	600525	长园集团	10,647,219.90	2.29
26	300038	梅泰诺	10,606,199.70	2.28
27	000050	深天马A	10,100,426.97	2.17
28	300433	蓝思科技	9,713,212.20	2.09
29	300219	鸿利智汇	9,453,017.72	2.03
30	300083	劲胜智能	9,384,800.00	2.02
31	000725	京东方A	9,379,297.00	2.01
32	002396	星网锐捷	9,359,974.00	2.01

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。

6.4.3 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	732,423,267.26
卖出股票收入(成交)总额	714,926,874.06

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。

6.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	2,669,016.88	0.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,669,016.88	0.67

6.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110040	生益转债	16,420	1,634,775.20	0.41
2	128035	大族转债	8,870	1,018,276.00	0.25
3	128018	时达转债	184	15,965.68	0.00

6.7 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。

6.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

6.9 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。

6.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.10.1 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。

6.10.2 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。

6.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.11.1 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。

6.11.2 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。

6.11.3 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。

6.12 投资组合报告附注

6.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，利亚德(300296)的发行主体于2018年5月4日收到深圳证券交易所《关于对利亚德光电股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，主要内容如下：利亚德公司在根据中国证监会《关于核准利亚德光电股份有限公司向周利鹤等发行股份购买资产并募集配套资金的批复》(证监许可[2015}1452号)募集相关配套资金9,128.43万元，2015年12月24日利亚德公司在未经董事会审议情况下，将9,128.43万元募集资金由募集资金专户汇至公司其他账户，以募集资金置换了先期投入的自有资金，并且直至2017年4月20日才补充履行了董事会审议程序及相关信息披露义务。

对如上股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名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。

6.12.2 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。

6.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,218.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,833.27
5	应收申购款	4,483.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,534.95

6.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110040	生益转债	1,634,775.20	0.41
2	128018	时达转债	15,965.68	0.00

6.12.5 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。

6.12.6 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。

§ 7 基金份额持有人信息

7.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,170	134,437.76	94,897,983.39	16.93%	465,707,467.80	83.07%

7.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

7.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 8 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年7月27日)基金份额总额	891,999,358.96
本报告期期初基金份额总额	558,292,769.23
本报告期基金总申购份额	107,061,698.32
减：本报告期基金总赎回份额	104,749,016.36
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	560,605,451.19

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

9.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	819,071,579.57	56.76%	435,174.11	46.22%	-
兴业证券	2	228,873,849.17	15.86%	190,260.80	20.21%	-
长江证券	2	209,467,213.39	14.52%	176,678.53	18.77%	-
中泰证券	1	135,951,912.09	9.42%	113,017.90	12.00%	-
平安证券	1	44,078,438.02	3.05%	23,418.90	2.49%	-
金元证券	1	5,612,108.00	0.39%	2,981.73	0.32%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
广发证券(已退租)	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

9.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	5,002,531.03	31.74 %	-	-	-	-
兴业证券	10,380,485.50	65.87%	-	-	-	-
长江证券	376,029.10	2.39%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
广发证券(已退租)	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用开源证券交易单元1个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字【1998】29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字【2007】48号)的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1)选择标准：

1)券商基本面评价(财务状况、经营状况)；

2)券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)；

3)券商每日信息评价(及时性和有效性)；

4)券商协作表现评价。

(2)选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 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。

§ 11

长信基金管理有限责任公司

2018年8月29日