

长信量化优选混合型证券投资基金（LOF） 2018 年半年度报告

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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2018 年 8 月 24 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.4 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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49

11.1 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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长信量化优选混合（LOF）
场内简称	长信优选
基金主代码	501003
交易代码	501003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 28 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,894,520.72 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 5 月 5 日

注：上市日期为长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）的上市日期，本基金由长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）转型而来。

2.2 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，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。
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*70% + 中债综合指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王健
	联系电话	021-61009999	021-38676252
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wangj222@gtjas.com

客户服务电话	4007005566	95521
传真	021-61009800	021-38677819
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东新区银城中路 68 号 32 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	成善栋	杨德红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报
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、上海银城中路 68 号时代金融中心 32 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	-4,156.53
本期利润	-70,635.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0472
本期加权平均净值利润率	-4.78%
本期基金份额净值增长率	-5.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-186,608.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0645
期末基金资产净值	2,707,912.12
期末基金份额净值	0.9355
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.70%

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。

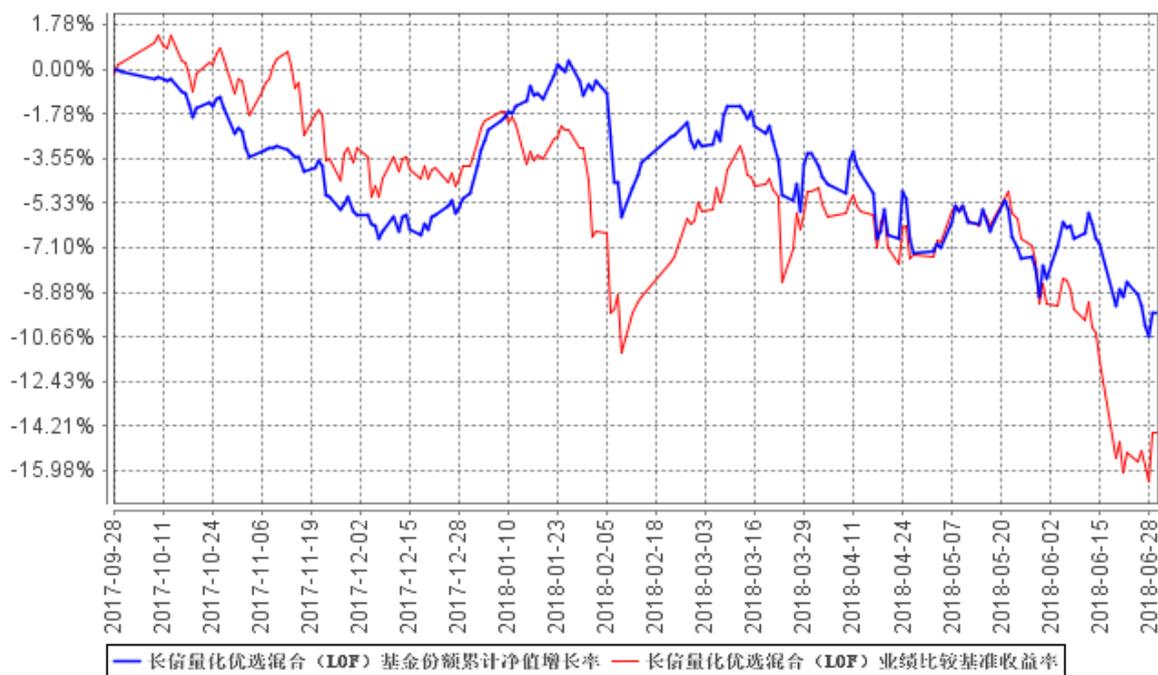
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-2.01%	0.89%	-6.45%	1.30%	4.44%	-0.41%
过去三个月	-6.58%	0.83%	-10.13%	0.97%	3.55%	-0.14%
过去六个月	-5.00%	0.77%	-11.07%	1.01%	6.07%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-9.70%	0.66%	-14.47%	0.90%	4.77%	-0.24%

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 2017-09-28，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿一年。图示日期为 2017-09-28 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未滿一年；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		
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	2017年9月28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、

	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				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。
邓虎	曾任本基金的基金经理	2017年9月28日	2018年4月23日	8年	曾任本基金的基金经理

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合规守信情况的说明

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

截止 2018 年 6 月 30 日，量化优选净值为 0.9355，报告期内基金净值收益率为-5.00%，同期业绩比较基准收益率为-11.07%。

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，指数估值水平平均回归至历史低位，个股涨幅中位数在-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，成长股板块先上涨后回调，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。最终，市场各主要指数在二季度均以回调收官，上证综指回调 13.30%，沪深 300 回调 12.90%，中证 500 回调 16.53%，中小板指回调 14.26%，创业板指回调 8.33%。

4.4.2 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 0.9355 元，份额累计净值为 0.9355 元，本报告期内本基金份额净值增长率为-5.00%，同期业绩比较基准收益率为-11.07%。

4.5 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。

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。

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、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，本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金的收益分配原则如下：

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、本基金场外申购的基金份额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；

场内申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，

具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

自 2017 年 9 月 28 日至 2017 年 12 月 26 日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万万元，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万万元。

§ 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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.6.1	2,035,549.47	1,225,320.14
结算备付金		-	6,934.66
存出保证金		458.47	76,517.96
交易性金融资产	6.4.6.2	752,027.00	891,107.00
其中：股票投资		752,027.00	891,107.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	591.34	676.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	394.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		2,788,626.28	2,200,949.99
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		28.27	9.77
应付管理人报酬		1,520.23	2,171.69
应付托管费		190.06	271.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	90.03	1,952.94

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	78,885.57	188,500.01
负债合计		80,714.16	192,905.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	2,894,520.72	2,039,188.68
未分配利润	6.4.6.10	-186,608.60	-31,144.58
所有者权益合计		2,707,912.12	2,008,044.10
负债和所有者权益总计		2,788,626.28	2,200,949.99

注：1、报告截止日 2018-06-30，基金份额净值 0.9355 元，基金份额总额 2894520.72 份。

2、本基金本报告期为 2018-01-01 至 2018-06-30，本基金基金合同于 2017-09-28 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：长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）

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	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-56,147.56
1.利息收入		6,432.55
其中：存款利息收入	6.4.6.11	6,432.55
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,805.86
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-17,339.16
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-
股利收益	6.4.6.16	14,533.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-66,478.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	6,704.59

减：二、费用		14,487.81
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	8,675.25
2. 托管费	6.4.9.2.2	1,084.50
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.6.19	1,040.30
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.6.20	3,687.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-70,635.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-70,635.37

注：本基金本报告期为2018-01-01至2018-06-30，本基金基金合同于2017-09-28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：长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）

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）	2,039,188.68	-31,144.58	2,008,044.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-70,635.37	-70,635.37
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）	855,332.04	-84,828.65	770,503.39
其中：1.基金申购款	1,676,767.43	-82,017.50	1,594,749.93
2.基金赎回款	-821,435.39	-2,811.15	-824,246.54
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）	2,894,520.72	-186,608.60	2,707,912.12

注：本基金本报告期为 2018-01-01 至 2018-06-30，本基金基金合同于 2017-09-28 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：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)（以下简称“长信中证上海改革发展指数(LOF)”）转型而成。长信中证上海改革发展指数(LOF)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》、《长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)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[2015]2701 号文和中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2017]511 号《关于长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》批准公开募集，于 2017 年 4 月 14 日募集成立。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 201,821,192.55 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 1700022 号验资报告。长信中证上海改革发展指数(LOF)的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

长信中证上海改革发展指数(LOF)于 2017 年 8 月 29 日起至 2017 年 9 月 22 日止期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会审议了《关于长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)修改法律文件的议案》，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过，决议于 2017 年 9 月 28 日生效。长信中证上海改革发展指数(LOF)由指数型基金变更为混合型基金，名称变更为“长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)”，修订后的《长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2017 年 9 月 28 日生效。本基金的基金

管理人和基金托管人保持不变。

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《长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)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)、权证,债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转债及分离交易可转债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)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权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:股票投资占基金资产的比例为 60-95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,本基金每个交易日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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 500 指数收益率 \times 70%+中债综合指数收益率 \times 30%。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	2,035,549.47
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,035,549.47

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	849,447.83	752,027.00	-97,420.83
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	849,447.83	752,027.00	-97,420.83

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	561.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	29.64
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.20
合计	591.34

注：其他为应收保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	90.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	90.03

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
审计费	24,795.19
信息披露费-上证报	24,795.19
信息披露费-证券时报	24,795.19
预提账户维护费_中债	4,500.00
合计	78,885.57

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,039,188.68	2,039,188.68
本期申购	1,676,767.43	1,676,767.43
本期赎回(以“-”号填列)	-821,435.39	-821,435.39
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,894,520.72	2,894,520.72

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,625.07	-82,769.65	-31,144.58
本期利润	-4,156.53	-66,478.84	-70,635.37
本期基金份额交易产生的变动数	15,929.79	-100,758.44	-84,828.65
其中：基金申购款	37,341.02	-119,358.52	-82,017.50
基金赎回款	-21,411.23	18,600.08	-2,811.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,398.33	-250,006.93	-186,608.60

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4.18
其他	176.35
合计	6,432.55

注：其他为直销申购款利息收入和保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益**6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	391,284.00
减：卖出股票成本总额	408,623.16
买卖股票差价收入	-17,339.16

6.4.6.13 债券投资收益**6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益**6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,533.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,533.30

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-66,478.84
——股票投资	-66,478.84
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-66,478.84

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,704.59
合计	6,704.59

注：本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,040.30
银行间市场交易费用	-
合计	1,040.30

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	1,095.92
信息披露费	2,191.84
银行间账户维护费	400.00
合计	3,687.76

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

基金管理人于 2018 年 7 月 6 日 0:00 起至 2018 年 8 月 1 日 17:00 止以通讯方式召开了长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）的基金份额持有人大会，审议《关于终止长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，于 2018 年 8 月 2 日表决通过，本次大会决议自该日起生效，2018 年 8 月 7 日起本基金进入清算程序。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	525,164.00	72.21%

注：本基金基金合同于 2017 年 9 月 28 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 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
国泰君安证券股 份有限公司	436.64	74.71%	26.61	29.56%

注：1、本基金基金合同于 2017 年 9 月 28 日起正式生效，无上年度可比期间数据；

2、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国泰君安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，还从国泰君安证券获得证券研究综合服务

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 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	8,675.25
其中：支付销售机构的客户维护费	1,038.26

注：1、本基金基金合同于 2017 年 9 月 28 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提，每日计提，按月支付。

管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值。

6.4.9.2.2 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	1,084.50

注：1、本基金基金合同于 2017 年 9 月 28 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，每日计提，按月支付。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金的银行存款存放在托管人国泰君安在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期内无源自本基金托管人国泰君安的银行存款及利息收入。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

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。

6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.11 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款由本基金的托管人国泰君安转存于中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级资产支持证券。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级同业存单。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级资产支持证券。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级同业存单。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的

生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,035,549.47	-	-	-	-	2,035,549.47
存出保证金	458.47	-	-	-	-	458.47
交易性金融资产	-	-	-	-	752,027.00	752,027.00
应收利息	-	-	-	-	591.34	591.34
资产总计	2,036,007.94	-	-	-	752,618.34	2,788,626.28
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	28.27	28.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,520.23	1,520.23
应付托管费	-	-	-	-	190.06	190.06
应付交易费用	-	-	-	-	90.03	90.03
其他负债	-	-	-	-	78,885.57	78,885.57
负债总计	-	-	-	-	80,714.16	80,714.16
利率敏感度缺口	2,036,007.94	-	-	-	671,904.18	2,707,912.12
上年度末 2017年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,225,320.14	-	-	-	-	1,225,320.14
结算备付金	6,934.66	-	-	-	-	6,934.66
存出保证金	76,517.96	-	-	-	-	76,517.96
交易性金融资产	-	-	-	-	891,107.00	891,107.00
应收利息	-	-	-	-	676.14	676.14
应收申购款	-	-	-	-	394.09	394.09
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,308,772.76	-	-	-	892,177.23	2,200,949.99
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	9.77	9.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,171.69	2,171.69
应付托管费	-	-	-	-	271.48	271.48
应付交易费用	-	-	-	-	1,952.94	1,952.94
其他负债	-	-	-	-	188,500.01	188,500.01
负债总计	-	-	-	-	192,905.89	192,905.89
利率敏感度缺口	1,308,772.76	-	-	-	699,271.34	2,008,044.10

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到

期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	752,027.00	27.77	891,107.00	44.38
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	752,027.00	27.77	891,107.00	44.38

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险
----	---------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	VaR 值为 1.07%（2017 年 12 月 31 日 VaR 值为 1.43%）	-28,895.29	-28,711.97

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2017 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 752,027.00 元，无属于第二、三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	752,027.00	26.97
	其中：股票	752,027.00	26.97
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	2,035,549.47	72.99
8	其他各项资产	1,049.81	0.04
9	合计	2,788,626.28	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	460,061.00	16.99
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	34,162.00	1.26

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	54,281.00	2.00
J	金融业	45,788.00	1.69
K	房地产业	145,607.00	5.38
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	12,128.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	752,027.00	27.77

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600566	济川药业	1,000	48,190.00	1.78
2	600690	青岛海尔	2,400	46,224.00	1.71
3	000651	格力电器	900	42,435.00	1.57
4	000895	双汇发展	1,600	42,256.00	1.56
5	000002	万科A	1,600	39,360.00	1.45
6	600066	宇通客车	1,900	36,461.00	1.35
7	600309	万华化学	800	36,336.00	1.34
8	000069	华侨城A	5,000	36,150.00	1.33
9	600340	华夏幸福	1,400	36,050.00	1.33
10	601318	中国平安	600	35,148.00	1.30
11	300296	利亚德	2,700	34,776.00	1.28
12	600153	建发股份	3,800	34,162.00	1.26
13	002146	荣盛发展	3,900	34,047.00	1.26
14	600585	海螺水泥	1,000	33,480.00	1.24
15	000786	北新建材	1,700	31,501.00	1.16
16	000333	美的集团	600	31,332.00	1.16

17	002597	金禾实业	1,500	30,420.00	1.12
18	600507	方大特钢	2,500	26,725.00	0.99
19	002279	久其软件	1,500	14,865.00	0.55
20	300188	美亚柏科	800	14,640.00	0.54
21	300170	汉得信息	800	12,992.00	0.48
22	600498	烽火通信	500	12,425.00	0.46
23	300182	捷成股份	1,600	12,128.00	0.45
24	300166	东方国信	800	11,784.00	0.44
25	601398	工商银行	2,000	10,640.00	0.39
26	300367	东方网力	600	7,500.00	0.28

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600507	方大特钢	37,620.00	1.87
2	600585	海螺水泥	37,320.00	1.86
3	002146	荣盛发展	37,177.00	1.85
4	002597	金禾实业	37,032.00	1.84
5	000069	华侨城 A	14,572.00	0.73
6	000651	格力电器	14,492.00	0.72
7	300188	美亚柏科	14,335.00	0.71
8	600887	伊利股份	14,050.00	0.70
9	600498	烽火通信	13,775.00	0.69
10	600566	济川药业	13,704.00	0.68
11	601318	中国平安	13,604.00	0.68
12	300170	汉得信息	13,432.00	0.67
13	300166	东方国信	13,400.00	0.67
14	601398	工商银行	11,360.00	0.57
15	300367	东方网力	10,770.00	0.54
16	600340	华夏幸福	9,559.00	0.48
17	300072	三聚环保	9,457.00	0.47
18	600066	宇通客车	6,876.00	0.34
19	300296	利亚德	4,787.00	0.24
20	600153	建发股份	4,423.00	0.22

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。

7.4.2 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	002202	金风科技	44,228.00	2.20
2	002002	鸿达兴业	39,160.00	1.95
3	600887	伊利股份	38,040.00	1.89
4	300072	三聚环保	32,006.00	1.59
5	601636	旗滨集团	23,060.00	1.15
6	002449	国星光电	19,955.00	0.99
7	000498	山东路桥	18,550.00	0.92
8	600755	厦门国贸	18,324.00	0.91
9	300440	运达科技	15,308.00	0.76
10	000528	柳 工	14,807.00	0.74
11	002067	景兴纸业	13,754.00	0.68
12	000830	鲁西化工	13,480.00	0.67
13	002111	威海广泰	13,208.00	0.66
14	600859	王 府 井	13,101.00	0.65
15	300118	东方日升	12,435.00	0.62
16	002706	良信电器	10,620.00	0.53
17	002567	唐 人 神	8,722.00	0.43
18	600035	楚天高速	8,440.00	0.42
19	601677	明泰铝业	7,824.00	0.39
20	000756	新华制药	6,953.00	0.35

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。

7.4.3 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	336,022.00
卖出股票收入（成交）总额	391,284.00

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。

7.5 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。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	458.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	591.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049.81

7.12.4 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。

7.12.5 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未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
455	6,361.58	0.00	0.00%	2,894,520.72	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	俞春玲	112,300.00	10.22%
2	陈桂芬	80,389.00	7.31%
3	姜吉品	55,974.00	5.09%
4	耿杰	50,000.00	4.55%
5	孙即亮	50,000.00	4.55%
6	史永强	50,000.00	4.55%
7	郭广泰	46,263.00	4.21%
8	余创成	45,024.00	4.10%
9	钱中明	44,100.00	4.01%
10	阙樟生	42,700.00	3.88%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	0.0000%

8.4 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年9月28日）基金份额总额	2,446,307.70
本报告期期初基金份额总额	2,039,188.68
本报告期基金总申购份额	1,676,767.43
减：本报告期基金总赎回份额	821,435.39
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	2,894,520.72

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人自 2018 年 7 月 6 日 0:00 起至 2018 年 8 月 1 日 17:00 止，以通讯方式召开长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）的基金份额持有人大会，审议《关于终止长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计 1,563,868.01 份，占权益登记日该基金总份额的 56.57%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的 99.99988%，本次会议议案于 2018 年 8 月 2 日获得通过，基金管理人已于 2018 年 8 月 6 日在指定信息披露媒介及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安	2	525,164.00	72.21%	436.64	74.71%	-
申港证券	1	202,142.00	27.79%	147.83	25.29%	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2017 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 4 日
3	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 5 日

4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 16 日
5	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 4 季度报告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 20 日
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 1 日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 6 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 7 日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 10 日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下 53 只基金修改基金合同、托管协议的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 24 日
11	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
12	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
14	长信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
15	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）2017 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 31 日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 18 日
17	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）2018 年第 1 季度报告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 20 日
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 21 日
19	长信基金管理有限责任公司关于长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 23 日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）恢复大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 26 日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加	上证报、中证报、证	2018 年 5 月 7 日

	嘉实财富管理有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	券时报、证券日报、 公司网站	
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 5 月 8 日
23	长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（2018 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报、 公司网站	2018 年 5 月 11 日
24	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 5 月 17 日
25	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 5 月 31 日
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 7 日
27	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 15 日
28	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 20 日
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 22 日
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 28 日
31	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动及网上银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 30 日
32	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 6 月 30 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2018 年 6 月 25 日至 2018 年 6 月 30 日	0.00	729,563.97	0.00	729,563.97	25.21%
	2	2018 年 6 月 25 日至 2018 年 6 月 30 日	0.00	833,787.40	0.00	833,787.40	28.81%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信量化优选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。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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8月29日