

长信量化优选混合型证券投资基金
(LOF) (原长信中证上海改革发展主题
指数型证券投资基金 (LOF))
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 27 日

§1 重要提示

长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）由长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事宜而来。基金管理人于2017年8月29日起至2017年9月22日期间召开长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，审议《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》，于2017年9月25日表决通过，议案自决议生效公告之日次日（即2017年9月28日）起实施，故长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）法律文件于2017年9月28日起生效，长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）法律文件于该日起失效。

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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2017年10月25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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

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
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
报告期末基金份额总额	2,445,817.13份
投资目标	本基金通过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。
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

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	长信中证上海改革发展指数（LOF）
场内简称	上海改革
基金主代码	501003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月14日
报告期末基金份额总额	2,446,307.70份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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收益率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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证上海改革发展主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证上海改革发展主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、

	混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

注：上表中“报告期期末”为2017年9月27日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年9月28日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	-2,608.23
2. 本期利润	-2,608.23
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0011
4. 期末基金资产净值	2,531,708.32
5. 期末基金份额净值	1.0351

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2017年9月28日，截至本报告期末，本基金运作未满足一个季度；

2、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；

3、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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日—2017年9月27日）
1. 本期已实现收益	2,795,953.44
2. 本期利润	889,519.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0092
4. 期末基金资产净值	2,534,824.68
5. 期末基金份额净值	1.036

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；

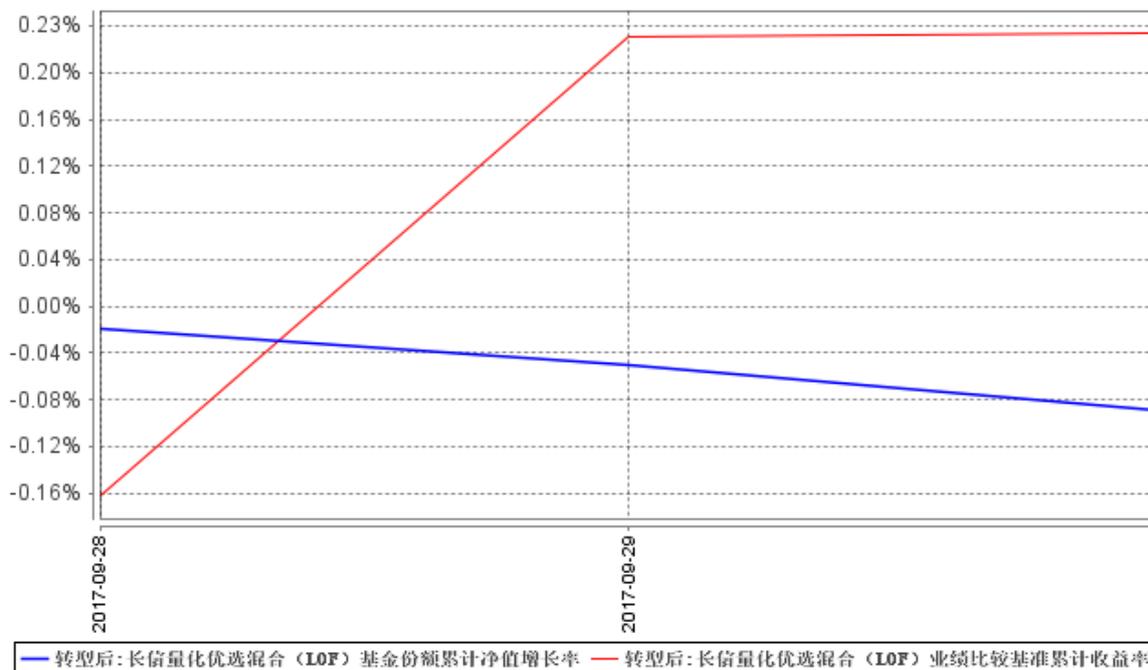
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

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
自基金合 同生效日 起至今 (2017年 9月28日 -2017年 9月30日)	-0.09%	0.01%	0.23%	0.28%	-0.32%	-0.27%

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、转型后的本基金基金合同生效日为2017年9月28日，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年9月28日至2017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，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

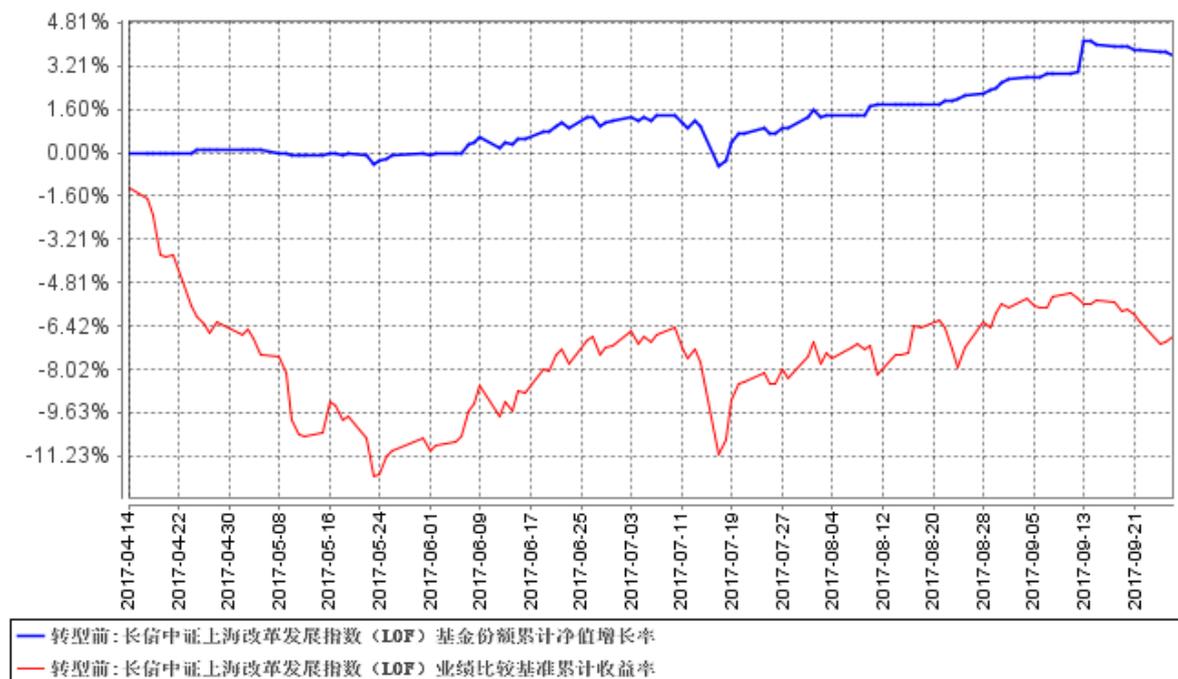
截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

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
2017年 7月1日- 2017年 9月27日 (基金合同 失效前日)	2.37%	0.28%	0.37%	0.71%	2.00%	-0.43%

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、本基金基金合同生效日为2017年4月14日，基金合同生效日至基金合同失效前日，本
第6页共19页

基金运作时间未满一年。图示日期为2017年4月14日至2017年9月27日（基金合同失效前日）。

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，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的90%，其中，中证上海改革发展主题指数成份股和备选成份股的资产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。

截至基金合同失效前日，本基金尚未完成建仓。

§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		
邓虎	长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（原长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF））的基	2017年4月14日	-	7年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2015年6月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司FOF投资部总监、长信中证一带一路主题指数分级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）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（原长信中

	金经理、 FOF 投资部总 监				证上海改革发展主题 指数型证券投资基金 （LOF））的基金经 理。
左金保	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、长信中 证一带一路主 题指数分级证 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 资基金和长信 量化优选混合 型证券投资基 金（LOF）（原 长信中证上海 改革发展主题 指数型证券投	2017年4月 22日	-	7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。曾任公司数量 分析研究员和 风险与绩效评估 研究员，现任量 化投资部总监、 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 中证一带一路主 题指数分级证券 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 和长信量化优选 混合型证券投资 基金（LOF） （原长信中证上 海改革发展主题 指数型证券投资 基金（LOF）） 的基金经理。

	资基金（LOF） 的基金经理、 量化投资部总 监			
--	-----------------------------------	--	--	--

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、自2017年9月28日起，长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）转型为长信量化优选混合型证券投资基金（LOF），邓虎和左金保仍担任该基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上海改革发展基金成立于2017年4月14日，是标的于中证上海改革发展主题指数的被动指数型基金，三季度仍处于建仓期。

本基金成立时恰逢市场高位并出现拐头向下的趋势，基于前期我们对市场的判断，在成立初期对基金空仓处理，二季度末开始逐步建仓，三季度在结构性行情中择机加仓，至季度末，大盘风格切换，前期获利稍有回吐。截止2017年9月30日，基金净值为1.0351元，三季度收涨2.28%，超越基准指数收益。

9月28日，本基金正式更名为长信量化优选，转型为偏股混合型基金。转型以后，本基金遵循量化投资的思想方式和方式，使用多因子模型综合考虑全市场股票的估值、流动性、成长性、盈利性、杠杆性及技术层面表现，为投资者谋求更为稳健的超额收益。

4.4.2 2017年四季度市场展望和投资策略

宏观层面，经济数据展现出足够的韧性，对于宏观经济不必过度悲观；上游强周期股及相关大宗商品价格自9月初后出现显著回落，流动性紧张的问题大概率不会恶化。市场层面，三季度市场整体较为活跃，股指期货等有升水表现，市场情绪稍有回暖，且节后“十九大行情”有望会为市场保温，四季度很可能延续震荡向上行情。因此，我们对市场持谨慎乐观的态度，A股震荡格局将会持续，大级别行情仍需等待。

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2017年9月30日，本基金单位净值为1.0351元，累计单位净值1.0351元。本报告期内转型前本基金净值增长率为2.37%，同期业绩比较基准涨幅为0.37%；本报告期内转型后本基金净值增长率为-0.09%，同期业绩比较基准涨幅为0.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2017年8月11日至2017年9月7日，长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。截至2017年9月27日长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同失效前日，本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 投资组合报告（转型后）

报告周期：2017年9月28日至2017年9月30日

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	-	-
	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	2,700,839.75	96.58
8	其他资产	95,623.21	3.42
9	合计	2,796,462.96	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

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

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	94,366.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,256.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,623.21

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

报告周期：2017年7月1日至2017年9月27日

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	-	-
	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	2,706,438.72	96.60
8	其他资产	95,245.84	3.40
9	合计	2,801,684.56	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 报告期末指数投资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。

5.2.1.2 报告期末积极投资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

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

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	94,366.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	879.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,245.84

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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。

5.11.6 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（转型后）

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	490.57
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”	-

“填列）	
报告期期末基金份额总额	2,445,817.13

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	189,995,453.62
报告期期间基金总申购份额	560,088.72
减：报告期期间基金总赎回份额	188,109,234.64
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	2,446,307.70

注：上表中“报告期期末”为2017年9月27日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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	2017年8月10日	12,848,808.37	0.00	12,848,808.37	0.00	0.00%
	2	2017年8月10日至2017年8月24日	16,490,484.10	0.00	16,490,484.10	0.00	0.00%
	3	2017年8月10日至2017年9月12日	18,946,200.58	0.00	18,946,200.58	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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>							

8.2 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。

§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、《长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 6、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 7、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 9、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
2017年10月27日