

# 长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2018 年 8 月 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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.....	15
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长信睿进混合	
基金主代码	519957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 6 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	391,969,885.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
下属分级基金场内简称:	睿进 A	睿进 C
下属分级基金的交易代码:	519957	519956
报告期末下属分级基金的份额总额	5,510,035.51 份	386,459,850.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>1) 行业配置策略 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>2) 个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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</p>

	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	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	崔瑞娟
	联系电话	021-61009999	020-87555888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4007005566	95575
传真		021-61009800	020-87555129
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼
邮政编码		200120	510620
法定代表人		成善栋	孙树明

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
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、广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 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

基金级别	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-477,292.62	-3,029,801.25
本期利润	-455,849.37	-5,324,315.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0761	-0.0291
本期加权平均净值利润率	-9.24%	-3.73%
本期基金份额净值增长率	-8.48%	-9.06%
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	-1,209,109.43	-97,759,633.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2194	-0.2530
期末基金资产净值	4,442,473.50	298,046,719.84
期末基金份额净值	0.8063	0.7712
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	-19.37%	-22.88%

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

长信睿进混合 A

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	-0.57%	0.37%	-4.37%	0.77%	3.80%	-0.40%
过去三个月	-0.70%	0.22%	-5.19%	0.68%	4.49%	-0.46%
过去六个月	-8.48%	0.70%	-6.18%	0.69%	-2.30%	0.01%
过去一年	-12.36%	0.84%	-0.68%	0.57%	-11.68%	0.27%

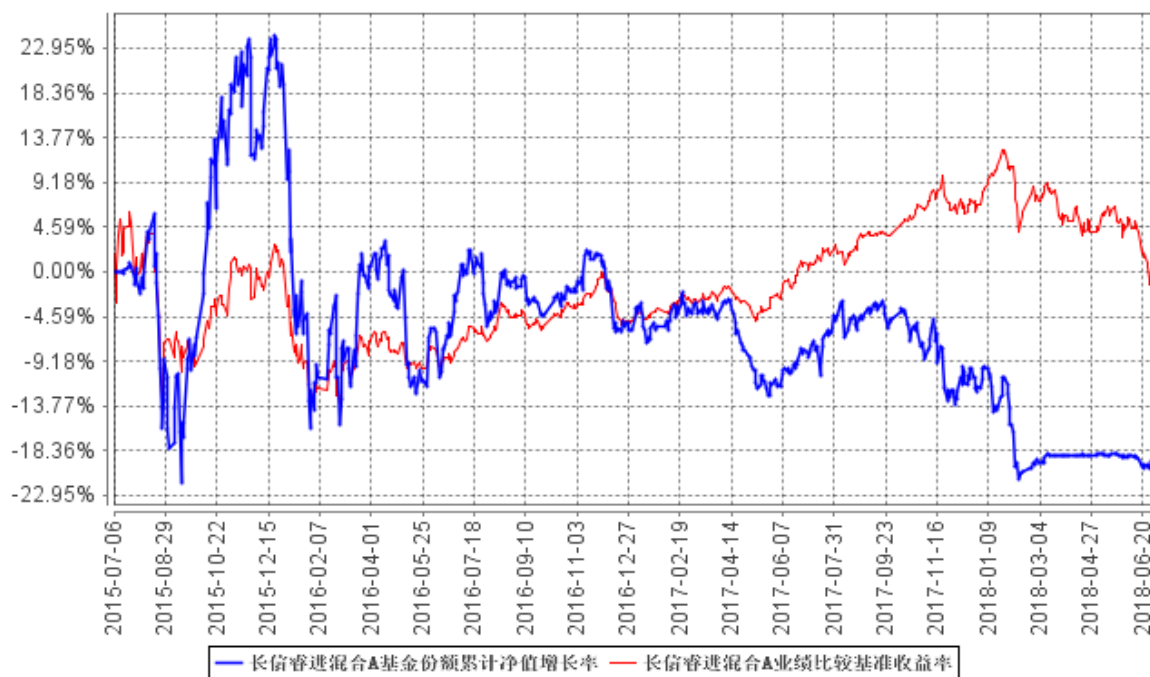


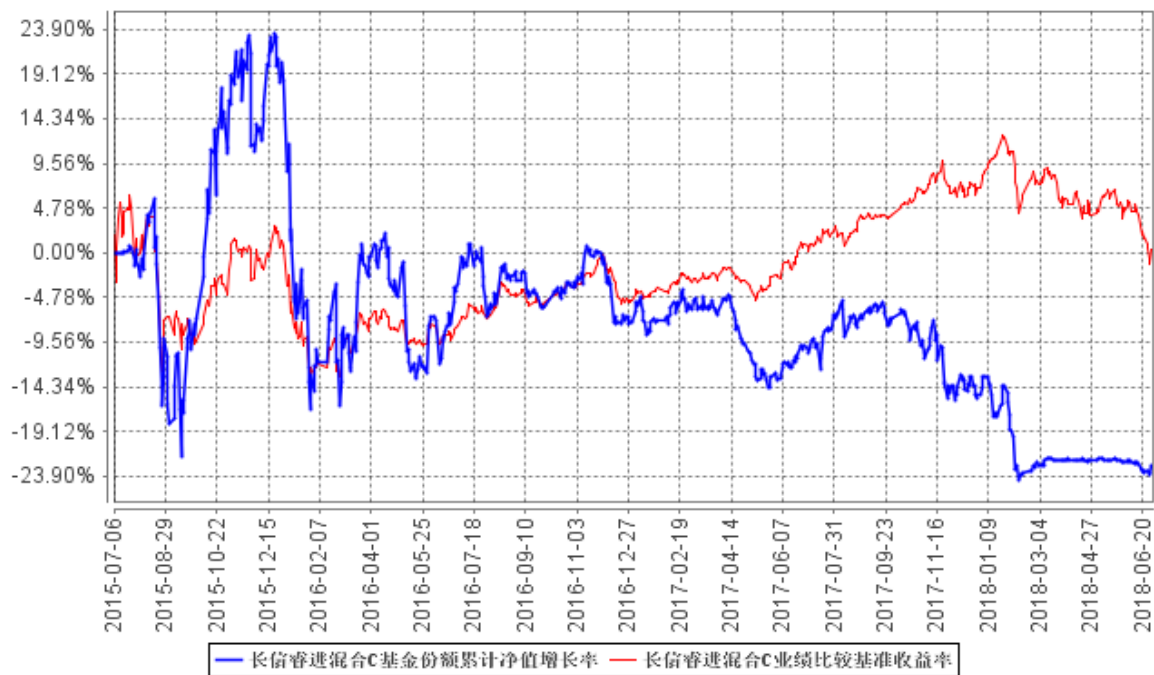
自基金合同生效起至今	-19.37%	1.67%	0.29%	0.88%	-19.66%	0.79%
------------	---------	-------	-------	-------	---------	-------

长信睿进混合 C

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	-0.64%	0.37%	-4.37%	0.77%	3.73%	-0.40%
过去三个月	-0.87%	0.22%	-5.19%	0.68%	4.32%	-0.46%
过去六个月	-9.06%	0.69%	-6.18%	0.69%	-2.88%	0.00%
过去一年	-14.31%	0.83%	-0.68%	0.57%	-13.63%	0.26%
自基金合同生效起至今	-22.88%	1.67%	0.29%	0.88%	-23.17%	0.79%

### 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、图示日期为 2015-07-06 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。

## § 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		
邓虎	曾任本基金的基金经理	2017年3月18日	2018年4月23日	8年	曾任本基金的基金经理
朱轶伦	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、长信先利半年定期开放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睿进灵活配置混合型基金基金经理	2018年3月17日	-	8年	金融学硕士，英国格拉斯哥大学国际金融专业硕士研究生毕业，上海财经大学计算机科学与技术本科，具有基金从业资格。曾在长信基金管理有限责任公司担任量化研究支持系统管理员、量化投资部研究员、量化专户投资部投资经理，现任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、长信先利半年定期开放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睿进灵活配置混合型基金基金经理。

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

股票方面：回顾一季度，诸如独角兽回归、两会召开、贸易战等各类事件频出，利好和利空因素叠加，致使市场情绪面较为波动，风格多变且分化明显，整体走势较为震荡。2018 年二季度诸如贸易战、棚改货币化收紧等利空事件持续发酵、股票市场 2018 年二季度各大指数收益率均回落明显。白马股、蓝筹股继今年一季度二月开始收益率大幅回落之后，二季度仍持续回落，同时创业板在一季度大幅反弹之后，二季度也大幅回落。报告期内，本基金股票投资以绝对收益为目标，二季度根据模型逐步提高股票的仓位，配置重点主要是中证 500 成分股。

债券方面：2018 年一季度，从流动性方面来看，资金面持续宽松，非银机构资金成本变化较

为平稳，维持在相对较低的位置，3 月底也未出现资金极度紧张的情况，二季度降准等利好事件频出，除受 4、5 月份缴税影响导致 4、5 月末流动性异常紧张之外，其余时间资金面持续宽松，非银机构资金成本变化较为平稳，维持在相对较低的位置。经济增长数据回落较为明显，其中固定资产投资中制造业和房地产投资增速放缓，基建投资回落明显，同时消费、出口和社融数据同比增速也持续回落，叠加贸易战等利空，对宏观环境冲击较为明显。报告期内，本基金债券投资以绝对收益为目标，保持稳健的操作策略，以短久期的利率债和同业存单为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信睿进混合 A 份额净值为 0.8063 元，份额累计净值为 0.8063 元，本报告期内长信睿进混合 A 份额净值增长率为-8.48%；长信睿进混合 C 份额净值为 0.7712 元，份额累计净值为 0.7712 元，本报告期内长信睿进混合 C 份额净值增长率为-9.06%。同期业绩比较基准收益率为-6.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从拉动经济增长的三驾马车来看，2018 年下半年需求总体仍然呈现缓慢回落趋势，制造业投资和消费、进出口数据增速放缓，基建投资维持低位，房地产政策趋紧也限制了房地产投资，整体来看经济增长下行压力较大，对下半年宏观经济偏悲观。股票投资上仍然会以绝对收益为目标，根据模型来调整股票仓位。

从流动性方面来看，我们认为三季度市场整体流动性依然会保持相对宽松，资金利率维持平稳趋势。债券投资上仍然保持稳健的操作策略，以短久期的利率债和同业存单为主。

本基金以绝对收益为目标，股票方面，仍然会根据模型来调整股票仓位。债券投资未来我们将保持稳定的仓位，积极布局优质的投资标的，结合严格的风险控制，使债券部分获得相对稳定的收益。

#### 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、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、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、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

3、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；

4、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；

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 12 月 13 日至 2018 年 3 月 12 日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万元，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。自 2018 年 4 月 4 日起至报告期末，本基金资产净值高于五千万元。

## § 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，本基金托管人在对长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长信睿进灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：长信睿进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	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	5,964,018.81	4,873,864.34
结算备付金		3,743,563.04	173,588.89
存出保证金		67,784.09	55,528.79
交易性金融资产	6.4.6.2	242,155,425.69	35,869,764.51
其中：股票投资		73,490,225.69	35,869,764.51
基金投资		-	-
债券投资		168,665,200.00	-
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	50,000,000.00	-
应收证券清算款		6,828,745.89	2,416.29
应收利息	6.4.6.5	1,593,197.66	849.39
应收股利		-	-
应收申购款		4,002.69	6,031.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		310,356,737.87	40,982,044.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		7,056,804.36	-
应付赎回款		9,118.03	107,644.56
应付管理人报酬		373,856.93	57,716.25
应付托管费		62,309.50	9,619.36
应付销售服务费		196,453.63	24,196.73
应付交易费用	6.4.6.7	85,603.60	105,906.65

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	83,398.48	210,000.09
负债合计		7,867,544.53	515,083.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	391,969,885.80	47,490,728.70
未分配利润	6.4.6.10	-89,480,692.46	-7,023,768.29
所有者权益合计		302,489,193.34	40,466,960.41
负债和所有者权益总计		310,356,737.87	40,982,044.05

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长信睿进混合 A 基金份额净值 0.8063 元，长信睿进混合 C 基金份额净值 0.7712 元。基金份额总额 391,969,885.80 份，其中长信睿进混合 A 份额 5,510,035.51 份，长信睿进混合 C 份额 386,459,850.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信睿进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	附注号	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
<b>一、收入</b>		-3,655,152.29	-134,185.84
1.利息收入		2,389,224.27	69,656.77
其中：存款利息收入	6.4.6.11	85,939.46	38,811.60
债券利息收入		1,576,713.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		726,571.75	30,845.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,782,097.73	-9,754,821.32
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-3,602,028.73	-10,130,521.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-360,350.00	-
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	180,281.00	375,699.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-2,273,070.65	9,540,912.01
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	10,791.82	10,066.70
<b>减：二、费用</b>		2,125,012.23	1,273,701.99
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	1,093,316.17	453,803.59
2. 托管费	6.4.9.2.2	182,219.41	75,633.94
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	563,536.58	208,499.90
4. 交易费用	6.4.6.19	193,554.50	418,126.21
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	92,385.57	117,638.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,780,164.52	-1,407,887.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,780,164.52	-1,407,887.83

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信睿进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）	47,490,728.70	-7,023,768.29	40,466,960.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,780,164.52	-5,780,164.52
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）	344,479,157.10	-76,676,759.65	267,802,397.45
其中：1.基金申购款	359,095,783.98	-79,637,558.06	279,458,225.92
2. 基金赎回款	-14,616,626.88	2,960,798.41	-11,655,828.47
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）	391,969,885.80	-89,480,692.46	302,489,193.34
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）	78,279,036.84	-5,687,322.33	72,591,714.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,407,887.83	-1,407,887.83
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）	-20,526,723.53	1,491,470.24	-19,035,253.29
其中：1.基金申购款	6,089,561.40	-456,637.10	5,632,924.30
2.基金赎回款	-26,616,284.93	1,948,107.34	-24,668,177.59
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）	57,752,313.31	-5,603,739.92	52,148,573.39

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1164号《关于准予长信睿进灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由长信基金管理有限责任公司向社会公开募集，基金合同于2015

年 7 月 6 日生效，首次设立募集规模为 308,604,154.67 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

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 0%-95%；债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%-100%。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。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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

#### 6.4.5.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### **6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加**

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的 7% 计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的 3% 计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的 2% 计缴。

#### **6.4.5.4 企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，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，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.5.5 个人所得税

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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	5,964,018.81
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：	5,964,018.81



**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	76,600,790.01	73,490,225.69	-3,110,564.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,129,741.50	37,458.50
	银行间市场	124,392,660.00	105,340.00
	合计	168,522,401.50	142,798.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	245,123,191.51	242,155,425.69	-2,967,765.82

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

**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	3,690.12
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	1,516.14

应收债券利息	1,563,958.35
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	24,005.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.45
合计	1,593,197.66

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 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	80,787.33
银行间市场应付交易费用	4,816.27
合计	85,603.60

#### 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	12.91
预提信息披露费	49,590.38
预提审计费	24,795.19
预提账户维护费	9,000.00
合计	83,398.48

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信睿进混合 A		
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	6,180,848.33	6,180,848.33
本期申购	1,184,981.65	1,184,981.65
本期赎回(以“-”号填列)	-1,855,794.47	-1,855,794.47
- 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	5,510,035.51	5,510,035.51

金额单位：人民币元

长信睿进混合 C		
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	41,309,880.37	41,309,880.37
本期申购	357,910,802.33	357,910,802.33
本期赎回(以“-”号填列)	-12,760,832.41	-12,760,832.41
- 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	386,459,850.29	386,459,850.29

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

长信睿进混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-876,445.32	143,969.61	-732,475.71
本期利润	-477,292.62	21,443.25	-455,849.37
本期基金份额交易产生的变动数	144,628.51	-23,865.44	120,763.07
其中：基金申购款	-250,591.64	34,956.73	-215,634.91
基金赎回款	395,220.15	-58,822.17	336,397.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,209,109.43	141,547.42	-1,067,562.01

单位：人民币元

长信睿进混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,194,680.05	903,387.47	-6,291,292.58
本期利润	-3,029,801.25	-2,294,513.90	-5,324,315.15
本期基金份额交易产生的变动数	-87,535,152.57	10,737,629.85	-76,797,522.72
其中：基金申购款	-90,525,638.27	11,103,715.12	-79,421,923.15
基金赎回款	2,990,485.70	-366,085.27	2,624,400.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-97,759,633.87	9,346,503.42	-88,413,130.45
-----	----------------	--------------	----------------

#### 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	59,363.29
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	10,819.11
其他	15,757.06
合计	85,939.46

注：其他中 530.82 元为保证金利息收入，15226.24 元为申购款利息收入。

#### 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	48,071,100.35
减：卖出股票成本总额	51,673,129.08
买卖股票差价收入	-3,602,028.73

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-360,350.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-360,350.00

##### 6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	146,015,066.98

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	142,885,700.00
减：应收利息总额	3,489,716.98
买卖债券差价收入	-360,350.00

#### 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	180,281.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	180,281.00

#### 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	-2,273,070.65
——股票投资	-2,415,869.15

——债券投资	142,798.50
——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	-2,273,070.65

#### 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	10,791.38
基金转换费收入	0.44
合计	10,791.82

注：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。

#### 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	190,704.50
银行间市场交易费用	2,850.00
合计	193,554.50

#### 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	24,795.19
信息披露费	49,590.38
账户维护费	18,000.00
合计	92,385.57

## 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

注：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

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 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

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。

### 6.4.8.2 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(以下简称“长信基金”)	基金管理人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金托管人、基金代销机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

## 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		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
广发证券	139,780,559.76	100.00%	143,424,740.11	100.00%

#### 6.4.9.1.2 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
广发证券	54,129,741.50	100.00%	-	-

**6.4.9.1.3 债券回购交易**

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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	2,524,000,000.00	100.00%	80,000,000.00	100.00%

**6.4.9.1.4 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。

**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
广发证券	130,177.47	100.00%	80,787.33	100.00%
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
广发证券	250,812.18	100.00%	125,791.11	100.00%

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广发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，还从广发证券股份有限公司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	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	1,093,316.17	453,803.59



的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	125,210.20	206,774.17

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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	182,219.41	75,633.94

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C	合计
长信基金	-	449,599.17	449,599.17
广发证券	-	91,516.49	91,516.49
长江证券	-	83.22	83.22
合计	-	541,198.88	541,198.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C	合计
长信基金	-	1,945.31	1,945.31
广发证券	-	155,365.43	155,365.43
长江证券	-	40.38	40.38
合计	-	157,351.12	157,351.12

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。

销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### **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。

#### **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自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自有资金投资本基金。

##### **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：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### **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。

#### **6.4.9.7 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。

#### **6.4.10 利润分配情况**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### **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**

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
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	36,400	977,034.00	727,636.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大资产购买事项	9.49	-	-	39,138	438,417.00	371,419.62	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58	2018年8月21日	17.62	13,600	360,042.00	266,288.00	-

**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**

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。

**6.4.11.3.2 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。

**6.4.12 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的建设，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。

本基金管理人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。

#### **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广发证券股份有限公司转存于中国建设银行股份有限公司，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公司的证券，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度末均未持有短期信用评级的债券。

##### **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度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**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	124,498,000.00	-
合计	124,498,000.00	-

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

#### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	44,167,200.00	0.00
合计	44,167,200.00	0.00

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 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度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度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流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 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，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

利率风险是指基金的财务状况和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、存出保证金及债券投资等。

##### 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	5,964,018.81	-	-	-	-	5,964,018.81
结算备付金	3,743,563.04	-	-	-	-	3,743,563.04
存出保证金	67,784.09	-	-	-	-	67,784.09
交易性金融资产	-	168,665,200.00	-	-	73,490,225.69	242,155,425.69
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	6,828,745.89	6,828,745.89
应收利息	-	-	-	-	1,593,197.66	1,593,197.66
应收申购款	-	-	-	-	4,002.69	4,002.69
资产总计	59,775,365.94	168,665,200.00	-	-	81,916,171.93	310,356,737.87
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	7,056,804.36	7,056,804.36
应付赎回款	-	-	-	-	9,118.03	9,118.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	373,856.93	373,856.93
应付托管费	-	-	-	-	62,309.50	62,309.50
应付销售服务费	-	-	-	-	196,453.63	196,453.63
应付交易费用	-	-	-	-	85,603.60	85,603.60
其他负债	-	-	-	-	83,398.48	83,398.48
负债总计	-	-	-	-	7,867,544.53	7,867,544.53
利率敏感度缺口	59,775,365.94	168,665,200.00	-	-	-74,048,627.40	302,489,193.34
上年度末	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2017 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,873,864.34	-	-	-	4,873,864.34
结算备付金	173,588.89	-	-	-	173,588.89
存出保证金	55,528.79	-	-	-	55,528.79
交易性金融资产	-	-	-	-35,869,764.51	35,869,764.51
应收证券清算款	-	-	-	2,416.29	2,416.29
应收利息	-	-	-	849.39	849.39
应收申购款	-	-	-	6,031.84	6,031.84
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,102,982.02	-	-	-35,879,062.03	40,982,044.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	107,644.56	107,644.56
应付管理人报酬	-	-	-	57,716.25	57,716.25
应付托管费	-	-	-	9,619.36	9,619.36
应付销售服务费	-	-	-	24,196.73	24,196.73
应付交易费用	-	-	-	105,906.65	105,906.65
其他负债	-	-	-	210,000.09	210,000.09
负债总计	-	-	-	515,083.64	515,083.64
利率敏感度缺口	5,102,982.02	-	-	-35,363,978.39	40,466,960.41

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率下降27个基点	351,254.24	0.00
	市场利率上升27个基点	-351,254.24	0.00

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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	73,490,225.69	24.30	35,869,764.51	88.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	168,665,200.00	55.76	-	-
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	242,155,425.69	80.05	35,869,764.51	88.64

#### 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 1.05%（2017 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.22%）	-3,166,534.21	-1,301,079.96

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

#### 6.4.13.1 公允价值

##### 6.4.13.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余



期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### **6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具**

##### **6.4.13.1.2.1 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 72,124,882.07 元，属于第二层次的余额为人民币 170,030,543.62 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

##### **6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### **6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额**

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### **6.4.13.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### **6.4.13.3 其他事项**

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	73,490,225.69	23.68
	其中：股票	73,490,225.69	23.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	168,665,200.00	54.35
	其中：债券	168,665,200.00	54.35
	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	50,000,000.00	16.11
	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	9,707,581.85	3.13
8	其他各项资产	8,493,730.33	2.74
9	合计	310,356,737.87	100.00

注：本基金本报告期末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	1,930,889.22	0.64
C	制造业	47,391,204.60	15.67
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	3,860,027.00	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,907,136.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,359,004.74	3.09
J	金融业	-	-

K	房地产业	2,996,669.00	0.99
L	租赁和商务服务业	1,812,899.13	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	727,636.00	0.24
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	3,504,760.00	1.16
S	综合	-	-
	合计	73,490,225.69	24.30

### 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	603883	老百姓	27,200	2,261,952.00	0.75
2	603019	中科曙光	49,000	2,247,630.00	0.74
3	002815	崇达技术	136,900	2,204,090.00	0.73
4	300166	东方国信	143,700	2,116,701.00	0.70
5	000681	视觉中国	72,200	2,072,140.00	0.69
6	002179	中航光电	51,349	2,002,611.00	0.66
7	600460	士兰微	160,400	1,956,880.00	0.65
8	600521	华海药业	73,000	1,948,370.00	0.64
9	002371	北方华创	39,100	1,942,097.00	0.64
10	000651	格力电器	41,000	1,933,150.00	0.64
11	000975	银泰资源	190,423	1,930,889.22	0.64
12	600754	锦江股份	51,600	1,907,136.00	0.63
13	002223	鱼跃医疗	94,700	1,845,703.00	0.61
14	002428	云南锗业	236,700	1,827,324.00	0.60
15	600967	内蒙一机	142,800	1,819,272.00	0.60
16	002127	南极电商	193,067	1,812,899.13	0.60
17	000977	浪潮信息	74,330	1,772,770.50	0.59
18	002332	仙琚制药	199,955	1,749,606.25	0.58
19	000066	中国长城	242,200	1,722,042.00	0.57
20	002032	苏泊尔	32,327	1,664,840.50	0.55

21	002390	信邦制药	224,700	1,644,804.00	0.54
22	000002	万 科 A	66,800	1,643,280.00	0.54
23	600729	重庆百货	48,500	1,598,075.00	0.53
24	002440	闰土股份	132,800	1,552,432.00	0.51
25	000333	美的集团	29,400	1,535,268.00	0.51
26	600426	华鲁恒升	86,300	1,518,017.00	0.50
27	600585	海螺水泥	45,100	1,509,948.00	0.50
28	300383	光环新网	109,600	1,469,736.00	0.49
29	002268	卫 士 通	67,164	1,466,190.12	0.48
30	300182	捷成股份	189,000	1,432,620.00	0.47
31	600673	东阳光科	137,800	1,423,474.00	0.47
32	000703	恒逸石化	95,211	1,416,739.68	0.47
33	601155	新城控股	43,700	1,353,389.00	0.45
34	002491	通鼎互联	121,043	1,339,946.01	0.44
35	002422	科伦药业	41,700	1,338,570.00	0.44
36	002410	广 联 达	47,100	1,306,083.00	0.43
37	300287	飞 利 信	169,600	1,219,424.00	0.40
38	002311	海大集团	55,400	1,168,940.00	0.39
39	600346	恒力股份	79,300	1,162,538.00	0.38
40	600566	济川药业	23,600	1,137,284.00	0.38
41	600195	中牧股份	57,700	1,122,265.00	0.37
42	002078	太阳纸业	98,600	955,434.00	0.32
43	300253	卫宁健康	66,700	826,413.00	0.27
44	000860	顺鑫农业	21,000	787,500.00	0.26
45	300266	兴源环境	36,400	727,636.00	0.24
46	000729	燕京啤酒	94,742	637,613.66	0.21
47	600600	青岛啤酒	11,500	504,045.00	0.17
48	300324	旋极信息	39,138	371,419.62	0.12
49	600410	华胜天成	36,200	316,750.00	0.10
50	002359	北讯集团	13,600	266,288.00	0.09

## 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	600460	士 兰 微	2,710,998.09	6.70
2	603883	老 百 姓	2,240,453.00	5.54

3	603019	中科曙光	2,229,347.00	5.51
4	002428	云南锗业	2,220,495.00	5.49
5	002815	崇达技术	2,212,325.00	5.47
6	002179	中航光电	2,178,602.47	5.38
7	002223	鱼跃医疗	2,161,560.00	5.34
8	000975	银泰资源	2,145,430.36	5.30
9	300166	东方国信	2,130,254.00	5.26
10	600521	华海药业	2,125,134.80	5.25
11	000651	格力电器	1,983,455.00	4.90
12	000681	视觉中国	1,983,396.00	4.90
13	600754	锦江股份	1,964,517.00	4.85
14	002032	苏泊尔	1,879,042.50	4.64
15	601155	新城控股	1,875,960.00	4.64
16	600967	内蒙一机	1,869,285.52	4.62
17	002127	南极电商	1,866,823.83	4.61
18	002268	卫士通	1,862,796.28	4.60
19	002390	信邦制药	1,843,526.00	4.56
20	002332	仙琚制药	1,813,515.85	4.48
21	000002	万科A	1,805,812.00	4.46
22	002371	北方华创	1,802,841.00	4.46
23	000066	中国长城	1,786,756.00	4.42
24	002440	闰土股份	1,779,466.00	4.40
25	000977	浪潮信息	1,730,426.70	4.28
26	600729	重庆百货	1,686,226.28	4.17
27	000333	美的集团	1,634,030.00	4.04
28	600585	海螺水泥	1,626,194.00	4.02
29	000860	顺鑫农业	1,621,301.00	4.01
30	300182	捷成股份	1,584,032.00	3.91
31	600426	华鲁恒升	1,576,485.00	3.90
32	300383	光环新网	1,537,232.00	3.80
33	002422	科伦药业	1,491,813.00	3.69
34	000703	恒逸石化	1,482,985.48	3.66
35	002491	通鼎互联	1,476,215.93	3.65
36	300287	飞利信	1,463,711.00	3.62
37	002311	海大集团	1,428,404.00	3.53
38	600673	东阳光科	1,405,675.00	3.47

39	002410	广联达	1,350,205.02	3.34
40	600346	恒力股份	1,252,978.84	3.10
41	600566	济川药业	1,185,753.00	2.93
42	000732	泰禾集团	1,181,128.00	2.92
43	000656	金科股份	1,150,306.00	2.84
44	600195	中牧股份	1,138,890.00	2.81
45	002078	太阳纸业	1,042,158.00	2.58
46	300409	道氏技术	872,250.00	2.16

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	300015	爱尔眼科	1,557,311.00	3.85
2	300498	温氏股份	1,407,513.40	3.48
3	300316	晶盛机电	1,293,226.00	3.20
4	300296	利亚德	1,293,224.00	3.20
5	300251	光线传媒	1,227,270.00	3.03
6	300182	捷成股份	1,202,722.90	2.97
7	300003	乐普医疗	1,168,277.00	2.89
8	300347	泰格医药	1,155,826.00	2.86
9	000656	金科股份	1,138,881.00	2.81
10	300009	安科生物	1,105,241.00	2.73
11	300122	智飞生物	1,098,697.20	2.72
12	000732	泰禾集团	1,078,058.00	2.66
13	300124	汇川技术	1,040,358.00	2.57
14	300144	宋城演艺	1,031,738.00	2.55
15	300197	铁汉生态	1,013,506.00	2.50
16	300274	阳光电源	1,010,578.00	2.50
17	300070	碧水源	1,009,683.00	2.50
18	300618	寒锐钴业	993,124.50	2.45
19	300136	信维通信	964,066.00	2.38
20	300463	迈克生物	929,005.00	2.30
21	300098	高新兴	908,748.00	2.25
22	300088	长信科技	894,517.00	2.21
23	300408	三环集团	885,729.00	2.19
24	300459	金科文化	874,998.00	2.16

25	000860	顺鑫农业	870,342.00	2.15
26	300203	聚光科技	863,446.00	2.13
27	300055	万邦达	851,351.00	2.10
28	300083	劲胜智能	849,941.00	2.10
29	300072	三聚环保	843,710.00	2.08
30	300433	蓝思科技	837,136.00	2.07
31	300355	蒙草生态	831,760.00	2.06

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	91,709,459.41
卖出股票收入（成交）总额	48,071,100.35

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

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	44,167,200.00	14.60
	其中：政策性金融债	44,167,200.00	14.60
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）	-	-
8	同业存单	124,498,000.00	41.16
9	其他	-	-
10	合计	168,665,200.00	55.76

### 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

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	111806114	18 交通银行 CD114	500,000	47,925,000.00	15.84
2	111821188	18 渤海银行 CD188	500,000	47,875,000.00	15.83
3	018005	国开 1701	440,000	44,167,200.00	14.60

4	111813043	18浙商银行 CD043	300,000	28,698,000.00	9.49
---	-----------	--------------	---------	---------------	------

### 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	67,784.09
2	应收证券清算款	6,828,745.89
3	应收股利	-
4	应收利息	1,593,197.66
5	应收申购款	4,002.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,493,730.33

### 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不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	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
长信睿进混合 A	509	10,825.22	0.00	0.00%	5,510,035.51	100.00%
长信睿进混合 C	3,873	99,783.08	0.00	0.00%	386,459,850.29	100.00%
合计	4,382	89,450.00	0.00	0.00%	391,969,885.80	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长信睿进混合 A	0.00	0.00%
	长信睿进混合 C	2,570.69	0.00%
	合计	2,570.69	0.00%

### 8.3 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	份额级别	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	长信睿进混合 A	0
	长信睿进混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信睿进混合 A	0
	长信睿进混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 6 日）基金份额总额	34,971,320.32	273,632,834.35
本报告期期初基金份额总额	6,180,848.33	41,309,880.37
本报告期基金总申购份额	1,184,981.65	357,910,802.33
减：本报告期基金总赎回份额	1,855,794.47	12,760,832.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	5,510,035.51	386,459,850.29

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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发生改变。

### 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	
广发证券	2	139,780,559.76	100.00%	130,177.47	100.00%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

财通证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-

### 10.7.2 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
广发证券	54,129,741.50	100.00%	2,524,000,000.00	100.00%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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国信证券交易单元 1 个，恒泰证券交易单元 1 个，天风证券交易单元 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。

### 10.8 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	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中证报、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部分开放式基金在上海长量基金销售投资顾问有限公司开通转换、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 2 月 2 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 6 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 7 日
10	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
11	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（2018 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时 报、公司网站	2018 年 2 月 14 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理的公告	中证报、证券时 报、公司网站	2018 年 3 月 17 日
13	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
14	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
15	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金托管协议（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分	上证报、中证报、	2018 年 3 月 29 日

	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	证券时报、公司网站	
17	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
18	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、公司网站	2018年3月31日
19	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
20	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2018年第1季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2018年4月20日
21	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
22	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2018年4月23日
23	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、证券时报、公司网站	2018年4月27日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加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	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018年5月7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8日
26	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
27	长信基金管理有限责任公司关于调整本公司旗下部分基金的基金份额净值计算小数点后保留位数的公告	中证报、证券时报、公司网站	2018年5月21日
28	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2018年5月21日
29	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2018年5月21日
30	长信基金管理有限责任公司关于增加上海	上证报、中证报、	2018年5月28日

	基煜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	证券时报、证券日报、公司网站	
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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

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。

### 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、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信睿进灵活配置混合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。

### 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