

长信量化中小盘股票型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期： 2018年3月31日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于2018年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信量化中小盘股票
场内简称	CXLH中小
基金主代码	519975
交易代码	519975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月4日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,433,377,179.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小盘股票，通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
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700指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼，上海市仙霞路18号

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年	2016年	2015年2月4日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-539,230,797.16	130,517,833.64	157,043,629.13
本期利润	-421,051,938.85	-79,947,785.52	192,305,977.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1429	-0.0803	0.5815
本期基金份额净值增长率	-14.22%	3.76%	42.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1166	0.0743	0.3257
期末基金资产净值	1,323,435,274.54	3,974,097,827.47	291,994,381.68
期末基金份额净值	0.923	1.076	1.424

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

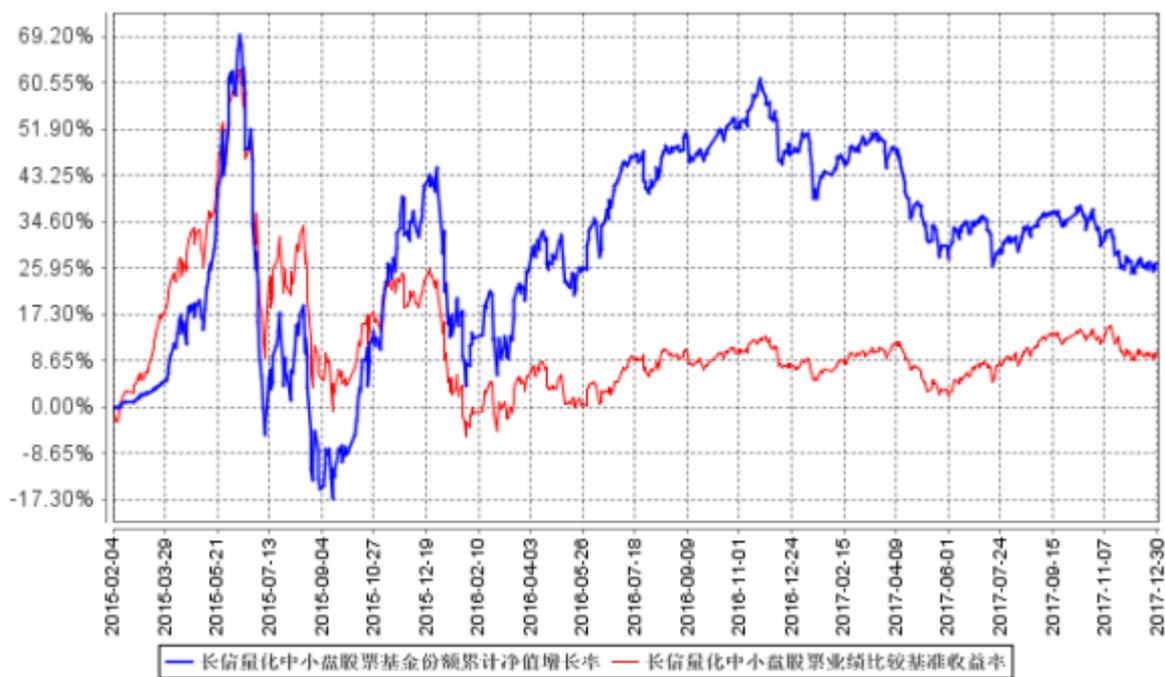
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.10%	0.85%	-2.55%	0.67%	-3.55%	0.18%
过去六个月	-5.62%	0.83%	2.24%	0.65%	-7.86%	0.18%
过去一年	-14.22%	0.90%	2.61%	0.63%	-16.83%	0.27%
自基金合同生效起至今	26.74%	1.97%	10.08%	1.49%	16.66%	0.48%

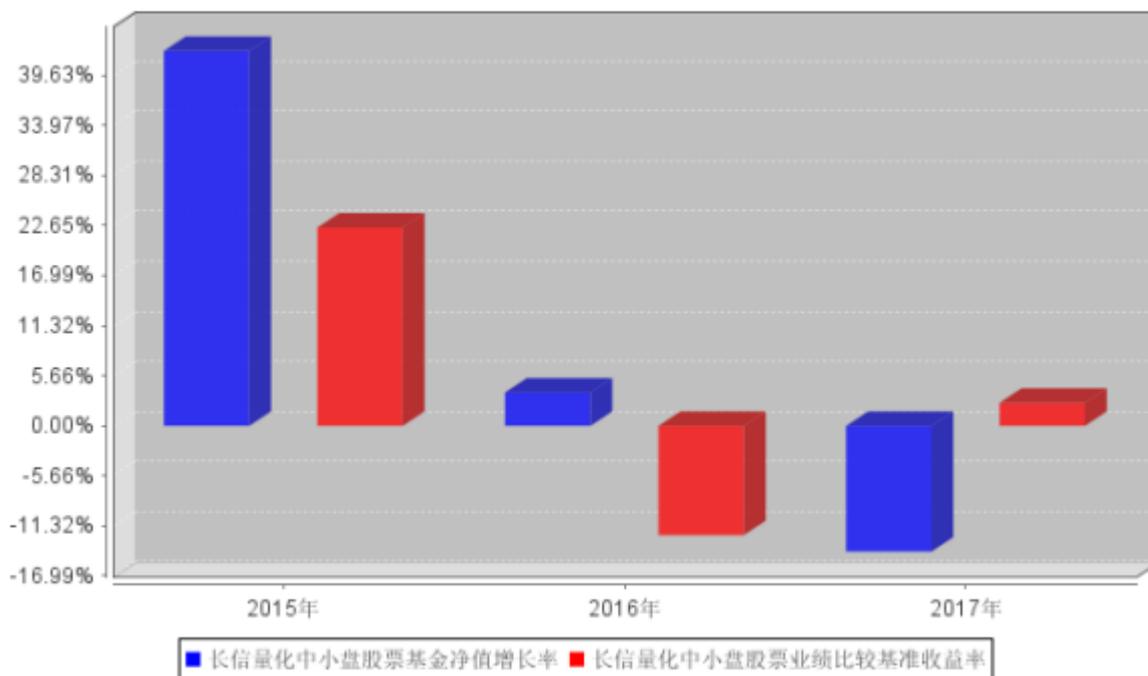
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2015年2月4日至2017年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例符合基金合同中的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2015年2月4日，2015年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	-	-	-	-	
2016年	4.000	613,891,703.62	75,657,569.65	689,549,273.27	
2015年	-	-	-	-	
合计	4.000	613,891,703.62	75,657,569.65	689,549,273.27	

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.7。

§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2017年12月31日，本基金管理人共管理58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)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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。

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、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（原长信中证上	2015年3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。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）（原长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF））和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理

	海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理、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2018年2月6日起，左金保先生不再担任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；

4、自2018年2月6日起，左金保先生开始担任长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、自2018年3月7日起，左金保先生开始担任长信消费精选行业量化股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5:1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

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2017年12月31日，本基金净值为0.9230元，本报告期内基金净值增长率为-14.22%，同期业绩比较基准收涨2.61%。

2017年市场发生极端风格分化行情。开年即遭遇市场调整，投资者观望情绪较重，风险偏好下降，大小盘股票走势开始出现较大分化。估值合理且业绩优秀的白马股和一线价值股受到投资者追捧，价值蓝筹风格在全年占优；以创业板为代表的成长股却遭投资者摒弃，全年大幅下跌且反弹乏力；周期股在年中也有优异表现，受益于业绩高速增长且估值较低，有色金属、钢铁、煤炭等均有阶段性投资机会。总体而言，上证综指收涨6.56%，沪深300指数收涨21.78%，中证500指数回调0.2%，中小板综指回调1.25%，创业板综指回调15.32%。

2017年对于量化基金而言是充满挑战的一年：一方面，多因子模型中仅估值因子一枝独秀，其他因子均表现平平，尤其是前期表现优异的市值、反转因子等都出现前所未有的反向情况；另一方面，这种风格极端分化的行情在一定程度上也不利于具有风格分散特点的量化型基金操作，这是主动量化型基金在本年普遍受挫的主要原因。经历了2017年，在继续坚持行业均衡、风格分散原则下，我们将进一步改进量化模型，增强模型对极端行情的适应能力和应变能力，以保证基金风格稳定和收益稳健性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金单位净值为0.923元，份额累计净值为1.323元，本报告期内本基金净值增长率为-14.22%，同期业绩比较基准涨幅为2.61%。

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2018年，我们认为需求总体呈现缓慢回落趋势，经济增长有下行压力但相对可控，且世界经济复苏进程为国内稳健增长提供了较好的外部环境；改革进程进一步深化，消费升级带来了经济增长逐渐由“量增”向“质增”的转变，经济结构持续优化，未来有望释放更多红利；从最新公布的1月通胀数据来看，通胀同比增速有望显著回升，PPI-CPI剪刀差有望缩窄，利于中下游业绩盈利。但另一方面，新上任的美联储主席鲍威尔偏鹰派的演讲引发投资者对美联储加息节奏的担忧，预计紧货币严监管仍将是2018年主题。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。我们相对看好受益于消费升级和改革红利的概念股，以及前期超跌处于价值洼地且业绩大幅利好的中小市值成长股。届时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。

4.6 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；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。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，估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。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。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6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017年度，基金托管人在长信量化中小盘股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017年度，长信基金管理有限责任公司长信量化中小盘股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化中小盘股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期末基金2017年度财务报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（德师报(审)字(18)第P00433号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	63,947,886.59	218,698,050.57
结算备付金	7,336,178.15	441,988,463.83
存出保证金	811,299.13	839,852.14
交易性金融资产	1,187,461,284.70	3,335,433,370.40
其中：股票投资	1,177,433,284.70	3,335,433,370.40
基金投资	-	-
债券投资	10,028,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	32,200,168.30	-
应收证券清算款	43,446,811.39	-
应收利息	117,174.62	254,231.50
应收股利	-	-
应收申购款	5,683,433.95	15,823,688.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,341,004,236.83	4,013,037,656.76
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	10,105,034.38	16,681,263.72
应付赎回款	1,657,601.33	12,008,551.52
应付管理人报酬	1,876,071.06	5,040,530.25
应付托管费	312,678.53	840,088.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,223,382.21	3,960,254.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	394,194.78	409,140.70

负债合计	17,568,962.29	38,939,829.29
所有者权益：		
实收基金	1,433,377,179.19	3,693,082,074.66
未分配利润	-109,941,904.65	281,015,752.81
所有者权益合计	1,323,435,274.54	3,974,097,827.47
负债和所有者权益总计	1,341,004,236.83	4,013,037,656.76

注：1、报告截止日2017年12月31日，基金份额净值0.923元，基金份额总额1,433,377,179.19份。

7.2 利润表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	-349,875,341.33	-49,807,286.32
1. 利息收入	6,288,130.24	2,682,816.71
其中：存款利息收入	5,976,919.51	2,619,724.55
债券利息收入	57,556.17	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	253,654.56	63,092.16
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-482,523,532.94	152,201,459.01
其中：股票投资收益	-498,182,041.87	151,169,359.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-540,140.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	16,198,648.93	1,032,099.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	118,178,858.31	-210,465,619.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	8,181,203.06	5,774,057.12
减：二、费用	71,176,597.52	30,140,499.20
1. 管理人报酬	44,700,503.29	17,000,299.63
2. 托管费	7,450,083.81	2,833,383.24
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	18,577,022.77	9,905,778.13
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	448,987.65	401,038.20

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-421,051,938.85	-79,947,785.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-421,051,938.85	-79,947,785.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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）	3,693,082,074.66	281,015,752.81	3,974,097,827.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-421,051,938.85	-421,051,938.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,259,704,895.47	30,094,281.39	-2,229,610,614.08
其中：1. 基金申购款	1,635,746,440.39	26,697,296.49	1,662,443,736.88
2. 基金赎回款	-3,895,451,335.86	3,396,984.90	-3,892,054,350.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,433,377,179.19	-109,941,904.65	1,323,435,274.54
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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）	204,999,315.96	86,995,065.72	291,994,381.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-79,947,785.52	-79,947,785.52
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）	3,488,082,758.70	963,517,745.88	4,451,600,504.58
其中：1. 基金申购款	4,496,119,206.48	1,123,085,064.27	5,619,204,270.75
2. 基金赎回款	-1,008,036,447.78	-159,567,318.39	-1,167,603,766.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-689,549,273.27	-689,549,273.27

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,693,082,074.66	281,015,752.81	3,974,097,827.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信量化中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2014]1360号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为869,346,402.40份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于2015年2月4日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信量化中小盘股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期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(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,投资于中小盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期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的比例范围是基金资产的5%-20%。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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准为:中证700指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%。

本基金的财务报表于2018年3月26日已经本基金的基金管理人批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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2017年12月31日的财务状况以及2017年1月1日至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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估计发生变更,对本基金本报告期无重大影响,会计政策与上年度会计报表一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《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》(证监会公告[2017]13号)和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定,本基金自2017年12月20日起,对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整,新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。于2017年12月20日,相关会计估计调整对基金资产净值的影响不超过0.25%。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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》、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、债券免征营业税和增值税；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。

7.4.7 关联方关系

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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
上海海欣集团股份有限公司(以下简称“海欣集团”)	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司(以下简称“武汉钢铁”)	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤胜投资”)	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤骏投资”)	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司

注：经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心(有限合伙)和上海彤骏投资管理中心(有限合伙)为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于2017年2月8日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
长江证券	3,344,195,735.10	23.65%	942,496,068.05	11.42%

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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
长江证券	30,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长江证券	3,032,398.90	32.40%	1,614,172.47	50.09%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长江证券	812,156.67	12.28%	763,254.86	19.28%

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	44,700,503.29	17,000,299.63
其中：支付销售机构的客户维护费	12,533,911.94	3,927,407.76

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,450,083.81	2,833,383.24

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

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	63,947,886.59	2,623,195.20	218,698,050.57	1,769,993.99

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，于2017年12月31日的相关余额为人民币7,336,178.15元。（2016年12月31日：人民币441,988,463.83元）。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 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	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
------	------	------	------	----	------	--------	-------	--------	--------	----

码				估值单 价						
300362	天翔环境	2017年12月28日	重大事项	12.92	2018年1月5日	13.50	1,114,200	16,779,805.87	14,395,464.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项	7.62	尚未复牌	尚未复牌	1,834,700	14,967,561.99	13,980,414.00	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	37.94	尚未复牌	尚未复牌	332,700	13,203,931.00	12,622,638.00	-
000900	现代投资	2017年10月27日	重大事项	6.25	尚未复牌	尚未复牌	1,071,400	6,568,061.00	6,696,250.00	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大事项	9.85	2018年3月8日	8.87	226,300	1,899,778.39	2,229,055.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	股价异动	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	股价异动	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,177,433,284.70	87.80
	其中：股票	1,177,433,284.70	87.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,028,000.00	0.75
	其中：债券	10,028,000.00	0.75
	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	32,200,168.30	2.40
	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	71,284,064.74	5.32
8	其他各项资产	50,058,719.09	3.73
9	合计	1,341,004,236.83	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	30,022,932.87	2.27
C	制造业	721,296,572.73	54.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,113,682.58	3.56
E	建筑业	40,799,277.54	3.08
F	批发和零售业	76,318,647.26	5.77
G	交通运输、仓储和邮政业	6,999,903.94	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,195,098.15	2.66
J	金融业	14,415,880.00	1.09
K	房地产业	138,739,148.51	10.48
L	租赁和商务服务业	13,824,000.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,188,202.20	2.43
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	20,519,938.92	1.55

S	综合	-	-
	合计	1,177,433,284.70	88.97

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600690	青岛海尔	1,120,000	21,100,800.00	1.59
2	000498	山东路桥	3,031,741	20,252,029.88	1.53
3	002016	世荣兆业	1,757,782	19,089,512.52	1.44
4	300230	永利股份	1,309,400	18,305,412.00	1.38
5	600657	信达地产	3,231,500	18,031,770.00	1.36
6	300157	恒泰艾普	1,963,401	17,906,217.12	1.35
7	002091	江苏国泰	1,992,512	17,872,832.64	1.35
8	002164	宁波东力	2,064,000	17,709,120.00	1.34
9	002706	良信电器	1,386,326	17,398,391.30	1.31
10	002636	金安国纪	1,088,906	17,237,381.98	1.30

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002604	龙力生物	105,991,109.71	2.67
2	300079	数码科技	101,685,464.54	2.56
3	002674	兴业科技	94,067,959.10	2.37
4	300326	凯利泰	94,013,527.65	2.37
5	300262	巴安水务	66,993,516.89	1.69
6	300143	星普医科	64,640,741.62	1.63
7	300112	万讯自控	61,704,517.13	1.55
8	002118	紫鑫药业	60,930,314.49	1.53
9	002374	丽鹏股份	57,898,839.02	1.46

10	300158	振东制药	38,459,748.99	0.97
11	002680	长生生物	37,297,189.78	0.94
12	300162	雷曼股份	37,043,961.39	0.93
13	300393	中来股份	37,022,703.32	0.93
14	601996	丰林集团	36,776,080.23	0.93
15	600803	新奥股份	36,140,480.33	0.91
16	600090	同济堂	36,036,952.62	0.91
17	002079	苏州固锝	35,610,686.00	0.90
18	300116	坚瑞沃能	35,323,018.34	0.89
19	002002	鸿达兴业	35,192,390.03	0.89
20	000501	鄂武商A	34,165,322.24	0.86

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。

8.4.2 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	300262	巴安水务	122,824,498.66	3.09
2	002321	华英农业	101,743,364.76	2.56
3	002507	涪陵榨菜	100,645,859.88	2.53
4	300138	晨光生物	98,737,152.70	2.48
5	300194	福安药业	96,348,588.15	2.42
6	600178	东安动力	94,823,272.08	2.39
7	002365	永安药业	90,567,048.26	2.28
8	002497	雅化集团	89,283,935.31	2.25
9	600589	广东榕泰	88,720,825.00	2.23
10	300158	振东制药	86,680,309.73	2.18
11	300303	聚飞光电	86,673,000.16	2.18
12	002604	龙力生物	86,131,316.81	2.17
13	000705	浙江震元	83,216,528.23	2.09
14	300326	凯利泰	83,111,920.95	2.09
15	002472	双环传动	81,138,377.23	2.04
16	300079	数码科技	80,717,494.15	2.03
17	002593	日上集团	76,342,098.56	1.92
18	002139	拓邦股份	72,561,750.16	1.83
19	002674	兴业科技	70,263,196.48	1.77

20	002253	川大智胜	69,500,080.91	1.75
----	--------	------	---------------	------

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。

8.4.3 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	6,184,912,701.11
卖出股票收入（成交）总额	7,962,923,273.25

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。

8.5 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	10,028,000.00	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,028,000.00	0.76

8.6 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	130023	13付息国债23	100,000	10,028,000.00	0.76

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 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	811,299.13
2	应收证券清算款	43,446,811.39
3	应收股利	-
4	应收利息	117,174.62
5	应收申购款	5,683,433.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	50,058,719.09

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
75,452	18,997.21	347,131,198.71	24.22%	1,086,245,980.48	75.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	108,665.36	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月4日）基金份额总额	869,346,402.40
本报告期期初基金份额总额	3,693,082,074.66
本报告期基金总申购份额	1,635,746,440.39
减:本报告期基金总赎回份额	3,895,451,335.86
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	1,433,377,179.19

§ 11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金非基金中基金，报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金更换会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币90,000.00元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为1年。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
		成交金额	占当期股票 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例

			例			
长江证券	2	3,344,195,735.10	23.65%	3,032,398.90	32.40%	-
海通证券	1	2,530,480,474.87	17.90%	1,344,450.96	14.37%	-
天风证券	1	2,151,306,887.39	15.21%	1,142,991.08	12.21%	-
华泰证券	2	2,051,519,092.51	14.51%	1,089,976.44	11.65%	-
东北证券	1	759,144,273.40	5.37%	403,333.90	4.31%	-
爱建证券	1	714,873,594.63	5.06%	379,812.84	4.06%	-
中泰证券	1	671,514,893.01	4.75%	558,232.87	5.97%	-
东方证券	1	620,865,812.45	4.39%	329,868.51	3.52%	-
光大证券	1	587,177,073.57	4.15%	488,119.03	5.22%	-
兴业证券	2	514,988,491.60	3.64%	428,110.62	4.57%	-
广发证券	1	154,728,495.39	1.09%	128,625.95	1.37%	-
广发证券（已退租）	1	38,928,927.04	0.28%	32,361.03	0.35%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

11.8.2 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
长江证券	-	-	30,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

爱建证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广发证券（已退租）	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化情况如下：

新增租用东北证券、金元证券、方正证券交易单元各1个，退租广发证券交易单元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》（证监基金字<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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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。

长信基金管理有限责任公司

2018年3月31日