

# 长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 3 月 23 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	13
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.10 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.....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	51
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	52
8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	53
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	62

8.6 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额 .....	64
8.7 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	65
8.8 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 .....	65
8.9 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 .....	65
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细 .....	65
8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金
基金简称	长信标普 100 等权重指数 (QDII)
场内简称	长信标普 100
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,780,561.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔 100 等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普 100 等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于 80% 的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。

	对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔 100 等权重指数总收益率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王永民
	联系电话	021-61009999	010-66594896
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4007005566	95566
传真		021-61009800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		成善栋	田国立

**2.4 境外投资顾问和境外资产托管人**

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank Of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

**2.5 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、上海证券报、证券时报
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、北京西城区复兴门内大街 1 号

**2.6 其他相关资料**

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-378,414.24	183,437.20	5,268,347.44
本期利润	2,609,539.72	486,973.74	2,462,373.09
加权平均基金份额本期利润	0.1279	0.0229	0.0901
本期加权平均净值利润率	12.15%	2.31%	8.59%
本期基金份额净值增长率	13.18%	2.33%	8.97%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	549,238.49	653,530.23	-358,062.95
期末可供分配基金份额利润	0.0154	0.0346	-0.0143
期末基金资产净值	40,864,063.23	19,065,280.92	24,688,956.06
期末基金份额净值	1.142	1.009	0.986
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	66.39%	47.01%	43.66%

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

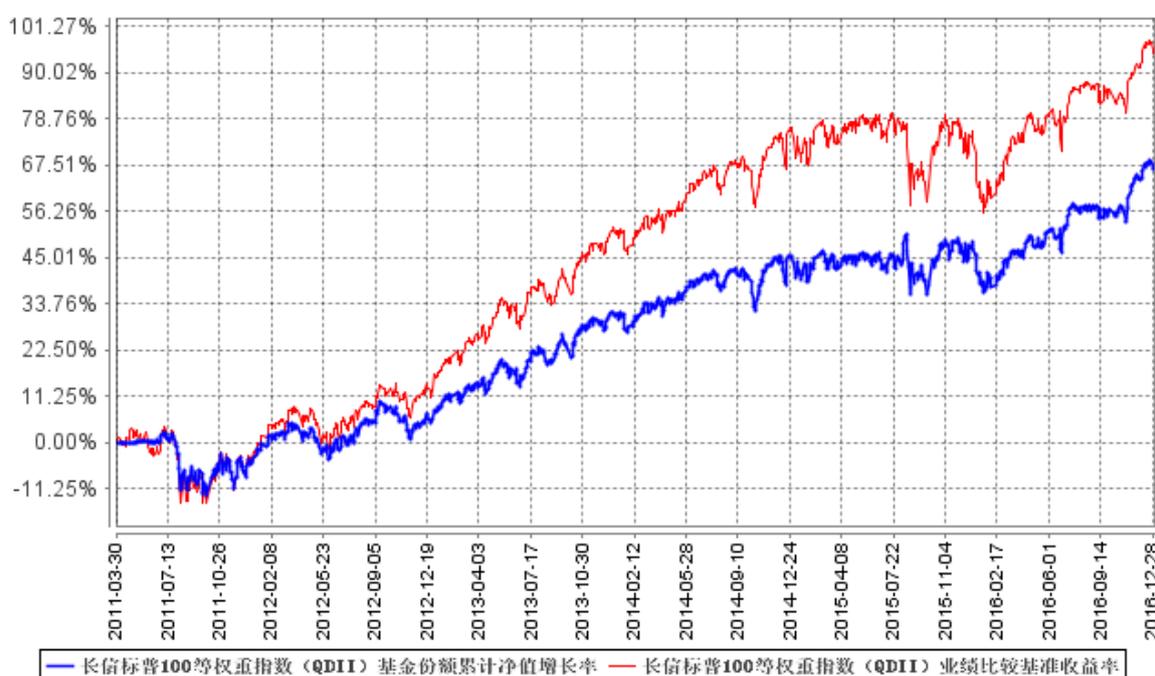
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	6.23%	0.50%	4.85%	0.56%	1.38%	-0.06%
过去六个月	9.49%	0.53%	8.82%	0.58%	0.67%	-0.05%

过去一年	13.18%	0.69%	12.69%	0.84%	0.49%	-0.15%
过去三年	26.21%	0.76%	28.03%	0.87%	-1.82%	-0.11%
过去五年	75.33%	0.73%	102.90%	0.84%	-27.57%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	66.39%	0.84%	94.93%	1.00%	-28.54%	-0.16%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

### 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

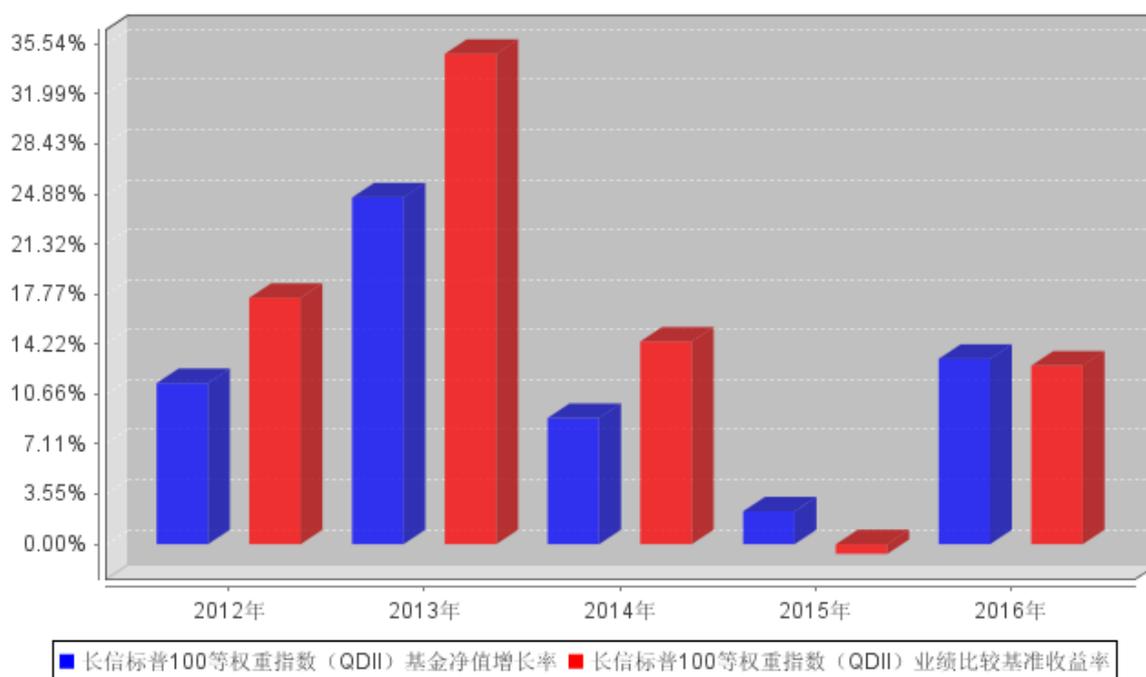


注：1、图示日期为2011年3月30日至2016年12月31日。

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已符合基金合同中的约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

### 3.2.3 过去五年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



### 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
2016年	-	-	-	-	
2015年	-	-	-	-	
2014年	1.860	3,555,957.39	1,238,729.78	4,794,687.17	
合计	1.860	3,555,957.39	1,238,729.78	4,794,687.17	

注：本基金本报告期没有进行利润分配。

## § 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 1.5 亿元人民币。实收资本 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）为 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为 4.54%。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 47 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。

## 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		
薛天	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理、国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员	2011 年 3 月 30 日	-	19 年	美国哥伦比亚大学工商管理硕士和公共卫生学硕士，具有美国 SEC 证券业务从业资格、英国 SFA 证券与金融衍生从业资格和中国基金从业资格。薛天先生在美国基金管理行业和投资研究行业有超过 10 年的工作经验。曾任法国巴黎银行（伦敦/纽约）股票分析师、花旗集团投资部基金经理、美国 Empyrean Capital Partners 基金经理和合伙人，一直从事证券研究和投资管理工作。于 2009 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算

标准。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金未聘请境外投资顾问。

## 4.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年是全球重大事件多发经济动荡的一年。一季度由于市场对货币政策转向的速度与力度有较大分歧,出现了大幅度的下降,增加了市场波动性。2 月初更是出现了两年来首次超出 10% 的调整,宏观经济数据喜忧参半,非农就业人口等重要数据表现符合或略超预期。2 月中期美国经济稍有好转,通胀在合理范围之内,股市上扬,经济呈现弱恢复趋势,通胀超预期的概率并不高。二季度美国市场的宏观数据则远不如预期,新增非农就业人口创新低,大幅降低美联储上半年加息概率。另外,6 月份英国公投脱欧的这一出人意料的结果引爆了全球股灾,导致美国 S&P500 指数重挫 3.6%,资金从而流向黄金,日元,美债避险。然而二季度末强劲的非农数据,也恢复了市场对于美股的信心,美股全面开涨,道指抹去英国脱欧后曾累计达到 4.8% 的跌幅,收复 18000 点整数位心理关口;标普 500 指数则抹去了英国脱欧公投后的所有跌幅,这一跌幅曾累计达到 5.3%。英国脱欧的这一结果也直接导致市场的避险情绪有较大起伏,美元的持续走高也令美国出口继续承压。7 月份的市场宏观数据依然远不如预期,黄金走高,美元下跌,8 月份景气指数又曝黑天鹅。整个第三季度伴随着是否加息的预期波动震荡,美元涨跌不定。四季度的另一黑天

鹅事件—特朗普当选为美国总统，使得大类资产的波动性上升，也导致了美国和世界主要经济体长端利率上升。选举过程中投资者的避险情绪导致 S&P 500 指数期货及纳指期货双双触发熔断机制，同时美国各年期国债收益率整体收窄至日内低点，欧元、英镑、日元及离岸人民币兑美元全部走强；特朗普当选总统后，得益于市场预计的宽松财政政策，市场逐渐消化避险情绪，扩大基建以及通货膨胀的预期升温，投资者看好美国基础设施建设前景，美元走强，美股大涨，资金流向美国，新兴市场货币遭遇贬值。12 月份美联储称通胀预期提升且劳动力市场改善，决定加息 25 个基点，为其一年来首次及十年来第二次加息，这一举措也严重影响了美国的股债市场。大选后，投资者预期经济基本面将得到改善，从而美国股市也有了明显的上升趋势。

美国 2016 年上半年的经济恢复是一次弱势恢复，经济或通胀超预期的概率不是很高。6 月份的英国公投脱欧使得 S&P 重挫 3.6%，美国股市上半年在经历了前两个月大幅下调后逐步上升。下半年波动性上升，在经历了特朗普的总统当选与 12 月的美联储加息，美国的股债市场均受到了巨大影响。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.142 元，份额累计净值为 1.538 元，本报告期内本基金净值增长率为 13.18%，同期业绩比较基准涨幅为 12.69%。本基金在 2016 年度的超额收益为 0.49%（已考虑人民币汇率影响）

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2017 年的展望，我们认为今年四季度的强势股市会得以延续。本基金将依然维持对美国经济基本面具有良好的宏观局面的看法，这是美国股市在中长期上升的根本原因。也会考虑到脱欧所带来的全球经济市场影响以及特朗普当选总统未来不确定的发展趋势，加之美国市场估值已经达到了较高的水平，我们仍然对美国股市采取谨慎的态度。短期内进行有选择性的调整仓位来获得超额收益；中长期而言，将密切关注市场走势，把握投资机会。从长期来看，在全球资产收益率普遍下降和强势美元背景下我们认为美国股市仍具有相对的吸引力。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

在本报告期，基金管理人的内部监察稽核主要工作如下：

1、公司内部控制总体目标得以实现。一是公司各项业务运作严格遵守有关法律法规、监管机构的规定和行业监管规则，继续践行守法经营、规范管理的经营理念。二是公司未发生重大经营风险，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整。三是公司对外披露、备案、报送的基金信息、专户投资组合信息、公司财务信息及其他信息真实、准确、完整、及时。公司始终以“合规运营，控制风险”为首要目标，梳理风险，积极应对外部变化，将合规理念传递到业务第一线，加强业务风控防线各岗位的自控与互控，从而有效防范并积极应对风险。

2、公司继续贯彻“工作精细化”理念，落实“风险导向型”内控，有重点、有序推进相关内部控制工作。优化监察方式，在完成公司多维度、多方位的风险全面梳理工作后，对前期梳理的风险及各项业务流程进行“回头看”。一是通过各部门的自查及合规部门的监督检查，核实对于前期梳理出的多项风险点的内部控制落实情况，检查是否存在未整改或执行不到位的情况；二是随着外部市场环境及监管要求的不断变化，需要定期对新业务、新环境下所面临的业务风险进行识别及剖析，针对新风险、高风险领域进行充分讨论，真正使风控走在业务的前面，建立有效的内部控制措施，减少风险事件的发生。

3、公司内部控制组织架构在公司章程与《内部控制大纲》规定的框架内顺利运作，董事会风险控制委员会、管理层内部控制委员会工作正常开展，相关内部控制职责得以充分发挥。

4、公司较好把握内控制度建设的整体节奏，并完成内部控制制度建设流程的梳理工作，内部控制制度体系不断完善。内部控制制度建设继续遵循合法合规、全面、审慎、科学、适时、自觉的原则，内部控制的制度性环境不断健全。一是对监管机关新修订的法律法规或新出台的监管要求，监察稽核部及时发起制定或修订公司相关内部制度；二是各业务部门不定期评估实际运作需要，适时发起制度的修订。

5、监察稽核工作改进、内部控制与合规培训、内控逐级责任制等内控保障性措施严格执行，内部控制与风险管理基础进一步夯实。公司着力于搭建多层次的沟通及信息传导平台。首先，内部控制委员会作为内部通报平台，定期召开会议，及时、适时将各项监管要求、公司内部控制及风险管控的总体情况进行通报；其次，部门间定期召开部门负责人和关键岗位员工专项沟通会议，作为内控的主要沟通平台，对业务操作过程中的实际情况进行评估，高效解决跨部门及部门内部存在的风险隐患；最后，由合规部门牵头，不定期针对各个部门及各个岗位员工开展合规与内部控制培训，建立合规要求传达平台，将各项内控要求传递到各个岗位员工。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工

作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由基金事务部、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。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。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，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。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

#### 4.9 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。

本基金收益分配原则如下：

- 1、基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、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，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 6、基金收益分配后每一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净值分配金额后不能低于面值；
- 7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **4.10 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**

截至 2014 年 11 月 7 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。本报告期内, 本基金资产净值仍持续低于五千万元。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）对长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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《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地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1700179 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金(以下简称“长信标普 100 等权重指数 (QDII)”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表,2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信标普 100 等权重指数 (QDII) 基金管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表

	编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，长信标普 100 等权重指数 (QDII) 基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长信标普 100 等权重指数 (QDII) 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	王国蓓	薛晨俊
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	12,641,946.23	2,752,244.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	28,337,630.46	15,650,983.85
其中：股票投资		28,337,630.46	15,650,983.85
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,347,328.10
应收利息	7.4.7.5	2,332.74	101.43
应收股利		25,147.32	19,414.63
应收申购款		1,031,733.06	300,383.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		42,038,789.81	20,070,455.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	460,546.83
应付赎回款		493,582.73	67,127.75
应付管理人报酬		31,882.26	17,325.90
应付托管费		8,695.18	4,725.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	640,566.41	455,449.27
负债合计		1,174,726.58	1,005,175.00
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	35,780,561.15	18,898,724.43
未分配利润	7.4.7.10	5,083,502.08	166,556.49
所有者权益合计		40,864,063.23	19,065,280.92
负债和所有者权益总计		42,038,789.81	20,070,455.92

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.142 元，基金份额总额 35,780,561.15 份。

## 7.2 利润表

公告主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

<b>一、收入</b>		3,277,398.28	1,193,347.48
1. 利息收入		15,005.55	3,088.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,005.55	3,088.04
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）		161,658.52	651,500.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-212,004.11	257,724.65
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	373,662.63	393,776.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,987,953.96	303,536.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		104,423.85	224,130.16
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	8,356.40	11,091.83
<b>减：二、费用</b>		667,858.56	706,373.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	234,722.98	233,019.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	64,015.35	63,550.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	3,884.25	4,166.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	365,235.98	405,637.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,609,539.72	486,973.74

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,609,539.72	486,973.74

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	18,898,724.43	166,556.49	19,065,280.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,609,539.72	2,609,539.72
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）	16,881,836.72	2,307,405.87	19,189,242.59
其中：1. 基金申购款	24,611,032.40	2,772,040.67	27,383,073.07
2. 基金赎回款	-7,729,195.68	-464,634.80	-8,193,830.48
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）	35,780,561.15	5,083,502.08	40,864,063.23
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	25,047,019.01	-358,062.95	24,688,956.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	486,973.74	486,973.74
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）	-6,148,294.58	37,645.70	-6,110,648.88
其中：1. 基金申购款	5,189,463.64	-42,618.18	5,146,845.46
2. 基金赎回款	-11,337,758.22	80,263.88	-11,257,494.34
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）	18,898,724.43	166,556.49	19,065,280.92

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：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2010】1586 号文)批准,由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》及其配套规则和《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2011 年 3 月 30 日生效。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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司(以下简称“中银香港”)。

本基金于 2011 年 2 月 28 日至 2011 年 3 月 25 日募集，募集资金总额人民币 507,960,871.41 元，利息转份额人民币 463,841.99 元，募集规模为 508,424,713.40 份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证，并出具了沪众会字(2011)第 2913 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》和《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种(包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等)；固定收益类品种(包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产)；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所(美国)挂牌交易的金融衍生品(包括期权期货)；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。本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12

月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

一所转移金融资产的账面价值

一因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

一本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

一本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日

认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时, 申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益, 包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量, 并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认, 在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债, 根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后, 逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异, 按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额, 在回购期内按实际利率法逐日确认, 直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额, 在回购期

内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、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，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 6、基金收益分配后每一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净值分配金额后不能低于面值；
- 7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制，是指本基金拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本基金是否拥有对被投资方的权力时，本基金仅考虑与被投资方相关的实质性权利（包括本基金自身所享有的及其他方所享有的实质性权利）。

#### 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不征收营业税。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂免征营业税和企业所得税。

(c) 目前基金取得的源自境外的股利收益, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(d) 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(以下称营改增)试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此, 截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金没有计提有关增值税费用。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	12,641,946.23	2,752,244.45

定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	12,641,946.23	2,752,244.45

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,230,438.89	28,337,630.46	3,107,191.57
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	25,230,438.89	28,337,630.46	3,107,191.57
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,531,189.66	15,650,983.85	119,794.19
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	15,531,189.66	15,650,983.85	119,794.19

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	2,330.53	101.43
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	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2.21	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	2,332.74	101.43

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用。

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,664.32	229.57
审计费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	245,000.00	245,000.00
指数授权费	284,417.00	142,859.20
指数使用费	49,485.09	7,360.50
合计	640,566.41	455,449.27

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	18,898,724.43	18,898,724.43
本期申购	24,611,032.40	24,611,032.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,729,195.68	-7,729,195.68
本期末	35,780,561.15	35,780,561.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

金额单位：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	646,301.29	-479,744.80	166,556.49
本期利润	-378,414.24	2,987,953.96	2,609,539.72
本期基金份额交易产生的变动数	281,351.44	2,026,054.43	2,307,405.87
其中：基金申购款	438,252.48	2,333,788.19	2,772,040.67

基金赎回款	-156,901.04	-307,733.76	-464,634.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	549,238.49	4,534,263.59	5,083,502.08

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	14,971.47	3,082.19
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	-	-
其他	34.08	5.85
合计	15,005.55	3,088.04

注：其他为申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,235,969.89	9,541,707.64
卖出股票成本总额	1,447,974.00	9,283,982.99
买卖股票差价收入	-212,004.11	257,724.65

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益****7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	373,662.63	393,776.26
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	373,662.63	393,776.26

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日

	月 31 日	月 31 日
1. 交易性金融资产	2,987,953.96	303,536.54
——股票投资	2,987,953.96	303,536.54
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	2,987,953.96	303,536.54

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,356.40	11,091.83
合计	8,356.40	11,091.83

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的 25%应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	3,884.25	4,166.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,884.25	4,166.59

**7.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	145,000.00	145,000.00
指数授权费	126,116.88	118,316.97
指数使用费	39,826.73	37,363.00
银行汇划费	4,292.37	8,626.39
待摊指数授权费	-	2,815.51
其他	-	33,515.41
合计	365,235.98	405,637.28

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

注：截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

注：截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

**7.4.9 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	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
中国银行（香港）有限公司	境外托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 债券交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.10.1.4 基金交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的基金交易。

**7.4.10.1.5 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	234,722.98	233,019.19
其中：支付销售机构的客户维护费	51,443.41	59,275.31

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 1.1% 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×1.1%/当年天数

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,015.35	63,550.68

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.3% 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×0.3%/当年天数

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.95%	52.92%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国银行股份有限公司	12,472,994.35	14,971.47	662,091.17	3,082.19
中国银行(香港)	168,951.88	-	2,090,153.28	-

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期间未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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。

**7.4.12.2 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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 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。

**7.4.12.3.2 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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

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。

### 7.4.13.2 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。为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司以及境外次托管行中国银行（香港）有限公司，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的量化投资部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	12,472,994.35	-	-	-	168,951.88	12,641,946.23
交易性金融资产	-	-	-	-	28,337,630.46	28,337,630.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	2,332.74	2,332.74
应收股利	-	-	-	-	25,147.32	25,147.32
应收申购款	-	-	-	-	1,031,733.06	1,031,733.06
资产总计	12,472,994.35	-	-	-	29,565,795.46	42,038,789.81
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	493,582.73	493,582.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	31,882.26	31,882.26
应付托管费	-	-	-	-	8,695.18	8,695.18
其他负债	-	-	-	-	640,566.41	640,566.41
负债总计	-	-	-	-	1,174,726.58	1,174,726.58
利率敏感度缺口	12,472,994.35	-	-	-	28,391,068.88	40,864,063.23
上年度末 2015 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	662,091.17	-	-	-	2,090,153.28	2,752,244.45
交易性金融资产	-	-	-	-	15,650,983.85	15,650,983.85
应收证券清算款	-	-	-	-	1,347,328.10	1,347,328.10
应收利息	-	-	-	-	101.43	101.43
应收股利	-	-	-	-	19,414.63	19,414.63
应收申购款	-	-	-	-	300,383.46	300,383.46
资产总计	662,091.17	-	-	-	19,408,364.75	20,070,455.92
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	460,546.83	460,546.83
应付赎回款	-	-	-	-	67,127.75	67,127.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	17,325.90	17,325.90
应付托管费	-	-	-	-	4,725.25	4,725.25
其他负债	-	-	-	-	455,449.27	455,449.27
负债总计	-	-	-	-	1,005,175.00	1,005,175.00
利率敏感度缺口	662,091.17	-	-	-	18,403,189.75	19,065,280.92

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	168,990.17	-	-	168,990.17
交易性金融资产	28,337,630.46	-	-	28,337,630.46
应收股利	25,147.32	-	-	25,147.32
资产合计	28,531,767.95	-	-	28,531,767.95
以外币计价的负债				
其它负债	333,902.09	-	-	333,902.09
负债合计	333,902.09	-	-	333,902.09
资产负债表外汇风险敞口净额	28,197,865.86	-	-	28,197,865.86
项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	2,090,180.55	-	-	2,090,180.55
交易性金融资产	15,650,983.85	-	-	15,650,983.85
应收股利	19,414.63	-	-	19,414.63
应收证券清算款	1,347,328.10	-	-	1,347,328.10
资产合计	19,107,907.13	-	-	19,107,907.13
以外币计价的负债				
应付证券清算款	460,546.83	-	-	460,546.83
其它负债	150,219.70	-	-	150,219.70
负债合计	610,766.53	-	-	610,766.53
资产负债表外汇风险敞口净额	18,497,140.60	-	-	18,497,140.60

## 7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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 (2016 年 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	美元对人民币升值 5%	1,409,893.29	924,857.03
	美元对人民币贬值 5%	-1,409,893.29	-924,857.03

## 7.4.13.4.3 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 12 月 31 日,本基金面临的其他市场价格风险列示如下:

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	28,337,630.46	69.35	15,650,983.85	82.09
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	28,337,630.46	69.35	15,650,983.85	82.09

#### 7.4.13.4.3.2 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 (2016 年 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	VaR 值为 0.96% (2015 年 12 月 31 日 VaR 值为 1.02%)	-391,396.00	-268,788.35

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。2015 年的分析同样基于该假设。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
资产				
交易性金融资产	—	—	—	—
股票投资	28,337,630.46	—	—	28,337,630.46
债券投资	—	—	—	—

合计	28,337,630.46	—	—	28,337,630.46
----	---------------	---	---	---------------

项目	上年度末 2015年12月31日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
资产				
交易性金融资产	—	—	—	—
股票投资	15,650,983.85	—	—	15,650,983.85
债券投资	—	—	—	—
合计	15,650,983.85	—	—	15,650,983.85

2016 年, 本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券, 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)、或属于限售期间等情况时, 本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更, 本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与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的层次。

2016 年, 本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2015 年 12 月 31 日: 无)。

(2) 其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 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	28,337,630.46	67.41
	其中：普通股	28,337,630.46	67.41
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,641,946.23	30.07
8	其他各项资产	1,059,213.12	2.52
9	合计	42,038,789.81	100.00

注：本基金本报告期未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	28,337,630.46	69.35
合计	28,337,630.46	69.35

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
电信服务	550,150.37	1.35
能源	2,048,206.14	5.01
金融	5,116,883.96	12.52
医疗保健	3,907,813.68	9.56
工业	3,814,596.45	9.33
材料	830,670.44	2.03
非日常生活消费品	3,893,001.81	9.53
公共事业	1,040,337.31	2.55
信息技术	4,088,653.09	10.01
日常消费品	2,811,161.12	6.88
房地产	234,174.39	0.57
合计	28,335,648.76	69.34

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

#### 8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	599.43	0.00
材料	1,382.27	0.00
合计	1,981.70	0.00

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称(中 文)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 列(%)
1	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	纽交所	美国	1,504	440,804.73	1.08
2	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	纽交所	美国	2,779	426,042.10	1.04
3	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽交所	美国	256	425,232.55	1.04
4	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	纽交所	美国	875	360,732.67	0.88
5	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽交所	美国	601	359,754.83	0.88
6	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽交所	美国	520	348,206.88	0.85
7	METLIFE INC	大都会集团	MET US	纽交所	美国	890	332,713.09	0.81
8	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金 融	COF US	纽交所	美国	547	331,035.58	0.81
9	US BANCORP	美国合众银 行	USB US	纽交所	美国	914	325,707.27	0.80
10	CATERPILL AR INC	卡特彼勒	CAT US	纽交所	美国	505	324,885.38	0.80

11	HALLIBURT ON CO	哈利伯顿	HAL US	纽交所	美国	865	324,567.32	0.79
12	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽交所	美国	270	323,390.45	0.79
13	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达 克	美国	712	322,032.19	0.79
14	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达 克	美国	745	321,143.56	0.79
15	GENERAL MOTORS CO	通用汽车	GM US	纽交所	美国	1,321	319,265.99	0.78
16	AMERICAN INTERNATI ONAL GROUP	美国国际集 团	AIG US	纽交所	美国	698	316,232.72	0.77
17	KINDER MORGAN INC	特拉华州金 德摩根公司	KMI US	纽交所	美国	2,194	315,201.60	0.77
18	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽交所	美国	291	314,266.08	0.77
19	TEXAS INSTRUMEN TS INC	德州仪器	TXN US	纽交所	美国	620	313,839.59	0.77
20	APPLE INC	苹果电脑	AAPL US	纳斯达 克	美国	388	311,736.02	0.76
21	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽交所	美国	432	310,706.57	0.76
22	BANK OF NEW YORK	纽约银行	BK US	纽交所	美国	932	306,325.16	0.75

	MELLON CORP							
23	CHEVRON CORP	雪佛龙德士 古	CVX US	纽交所	美国	375	306,181.84	0.75
24	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽交所	美国	237	306,125.65	0.75
25	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIRE HATH-B	BRK/B US	纽交所	美国	270	305,259.91	0.75
26	BIOGEN INC	百健艾迪	BIIB US	纳斯达 克	美国	155	304,915.14	0.75
27	UNITEDHEA LTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽交所	美国	274	304,194.11	0.74
28	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽交所	美国	794	303,544.67	0.74
29	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通公 司	AXP US	纽交所	美国	590	303,196.85	0.74
30	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达 克	美国	1,199	301,674.38	0.74
31	CONOCOPHI LLIPS	康菲石油	COP US	纽交所	美国	862	299,821.86	0.73
32	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达 克	美国	372	298,700.28	0.73
33	COMCAST CORP-CLAS S A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达 克	美国	611	292,668.91	0.72
34	ALLSTATE	全州保险	ALL US	纽交所	美国	569	292,562.98	0.72

	CORP							
35	UNITED PARCEL SERVICE-C L B	ups 公司	UPS US	纽交所	美国	367	291,859.57	0.71
36	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机 器	IBM US	纽交所	美国	251	289,019.63	0.71
37	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	杜邦	DD US	纽交所	美国	567	288,702.68	0.71
38	MASTERCAR D INC-CLASS A	万事达卡	MA US	纽交所	美国	402	287,930.59	0.70
39	BLACKROCK INC	贝莱德有限 公司	BLK US	纽交所	美国	109	287,738.85	0.70
40	PAYPAL HOLDINGS INC	PayPal 控股 股份有限公 司	PYPL US	纳斯达 克	美国	1,044	285,850.74	0.70
41	DOW CHEMICAL CO/THE	陶氏化学	DOW US	纽交所	美国	720	285,793.30	0.70
42	UNITED TECHNOLOG IES CORP	联合技术	UTX US	纽交所	美国	375	285,162.73	0.70
43	WALT DISNEY CO/THE	沃尔特迪斯 尼	DIS US	纽交所	美国	394	284,851.81	0.70

44	PCLN US	Priceline 集团	PCLN US	纳斯达克	美国	28	284,761.63	0.70
45	SCHLUMBER GER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽交所	美国	488	284,192.24	0.70
46	TARGET CORP	Target 百货	TGT US	纽交所	美国	564	282,597.56	0.69
47	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	纽交所	美国	728	281,545.08	0.69
48	3M CO	3M 公司	MMM US	纽交所	美国	227	281,194.00	0.69
49	AMAZON. CO M INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	54	280,899.80	0.69
50	AT&T INC	美国电话电 报公司	T US	纽交所	美国	951	280,574.11	0.69
51	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽交所	美国	1,279	280,368.57	0.69
52	CISCO SYSTEMS INC	思科系统公 司	CSCO US	纳斯达克	美国	1,323	277,348.61	0.68
53	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽交所	美国	297	276,243.55	0.68
54	RAYTHEON COMPANY	雷神公司	RTN US	纽交所	美国	280	275,815.12	0.67
55	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马 丁	LMT US	纽交所	美国	159	275,679.57	0.67
56	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽交所	美国	675	275,657.30	0.67

57	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	纳斯达 克	美国	247	274,338.72	0.67
58	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纽交所	美国	1,109	273,029.29	0.67
59	ABBVIE INC	艾博维公司	ABBV US	纽交所	美国	628	272,800.02	0.67
60	ALTRIA GROUP INC	高利特	MO US	纽交所	美国	580	272,066.37	0.67
61	DANAHER CORP	丹納赫	DHR US	纽交所	美国	503	271,607.97	0.66
62	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达 克	美国	700	269,599.57	0.66
63	VERIZON COMMUNICA TIONS INC	Verizon 通 信	VZ US	纽交所	美国	728	269,576.26	0.66
64	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纽交所	美国	371	269,278.59	0.66
65	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	纽交所	美国	461	268,884.22	0.66
66	WALGREEN BOOTS ALLTANCE	沃尔格林联 合博姿集团	WBA US	纽交所	美国	465	266,959.35	0.65
67	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚 石油	XOM US	纽交所	美国	426	266,732.92	0.65
68	ABBOTT LABORATOR IES	雅培制药	ABT US	纽交所	美国	1,000	266,450.17	0.65

69	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽交所	美国	519	264,802.29	0.65
70	ORACLE CORP	甲骨文公司	ORCL US	纳斯达 克	美国	991	264,327.10	0.65
71	MCDONALDS CORP	麦当劳	MCD US	纽交所	美国	313	264,288.32	0.65
72	HONEYWELL INTERNATI ONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纽交所	美国	328	263,597.68	0.65
73	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲	ACN US	纽交所	美国	324	263,259.98	0.64
74	MONDELEZ INTERNATI ONAL INC	Mondelez 国 际公司	MDLZ US	纳斯达 克	美国	853	262,312.18	0.64
75	FACEBOOK INC-A	Facebook 公 司	FB US	纳斯达 克	美国	328	261,777.41	0.64
76	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽交所	美国	327	261,342.25	0.64
77	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	纽交所	美国	478	258,705.43	0.63
78	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	WMT US	纽交所	美国	539	258,442.65	0.63
79	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源 公司	NEE US	纽交所	美国	310	256,895.15	0.63
80	SOUTHERN CO	南方	SO US	纽交所	美国	751	256,264.50	0.63

81	MONSANTO CO	孟山都	MON US	纽交所	美国	351	256,174.46	0.63
82	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	纽交所	美国	472	254,148.37	0.62
83	OCCIDENTA L PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽交所	美国	509	251,508.36	0.62
84	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克 克	美国	247	250,521.92	0.61
85	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽交所	美国	2,934	246,883.81	0.60
86	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽交所	美国	697	245,767.57	0.60
87	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽交所	美国	1,088	245,141.37	0.60
88	COLGATE-P ALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	纽交所	美国	532	241,505.27	0.59
89	LOWES COS INC	劳氏	LOW US	纽交所	美国	489	241,252.77	0.59
90	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽交所	美国	835	240,152.70	0.59
91	PHILIP MORRIS INTERNATI ONAL	菲利普莫里 斯国际集团	PM US	纽交所	美国	378	239,903.80	0.59
92	SIMON PROPERTY	Simon Property	SPG US	纽交所	美国	190	234,174.39	0.57

	GROUP INC							
93	ALLERGAN PLC	艾尔建制药 公司	AGN US	纽交所	美国	159	231,637.46	0.57
94	GILEAD SCIENCES INC	Gilead 科学	GILD US	纳斯达 克	美国	453	225,031.63	0.55
95	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽交所	美国	448	221,366.88	0.54
96	CVS CAREMARK CORP	CVS 公司	CVS US	纽交所	美国	397	217,317.27	0.53
97	BRISTOL-M YERS SQUIBB CO	百时美施贵 宝	BMJ US	纽交所	美国	527	213,644.89	0.52
98	Twenty-Fi rst Century Fox	二十一世纪 福克斯公司	FOXA US	纳斯达 克	美国	957	186,149.40	0.46
99	GOOGL US	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	25	137,430.64	0.34
100	GOOGLE INC-CL A	谷歌	GOOG US	纳斯达 克	美国	25	133,852.88	0.33
101	FOX US	新闻集团	FOX US	纳斯达 克	美国	368	69,564.24	0.17
102	DELL TECHNOLOG IES	Dell Technologie s 公司	DVMT US	纽交所	美国	154	58,724.34	0.14

#### 8.4.1 积极投资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益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产 净值比列 (%)
1	ADVANSIX INC Equity	Advansix 公司	ASIX US	NYSE	US	9	1,382.27	0.00
2	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	NYSE	US	1	599.43	0.00

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	DANAHER CORP	DHR US	293,399.10	1.54
2	DUKE ENERGY CORP	DUK US	248,731.42	1.30
3	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	245,424.82	1.29
4	MORGAN STANLEY	MS US	187,399.17	0.98
5	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	178,609.84	0.94
6	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	171,656.70	0.90
7	CITIGROUP INC	C US	149,094.08	0.78
8	GENERAL MOTORS CO	GM US	148,848.52	0.78
9	TARGET CORP	TGT US	142,415.55	0.75
10	BIOGEN INC	BIIB US	139,318.58	0.73
11	APPLE INC	AAPL US	136,275.25	0.71
12	METLIFE INC	MET US	133,656.22	0.70

13	KINDER MORGAN INC	KMI US	130,615.62	0.69
14	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	129,170.66	0.68
15	BOEING CO/THE	BA US	128,252.47	0.67
16	MICROSOFT CORP	MSFT US	127,698.39	0.67
17	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	127,564.79	0.67
18	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	127,455.67	0.67
19	WELLS FARGO & CO	WFC US	126,084.26	0.66
20	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	125,556.10	0.66

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。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	EMC CORP/MASS	EMC US	157,111.32	0.82
2	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	145,950.67	0.77
3	NORFOLK SOUTHERN CORP	NSC US	145,372.64	0.76
4	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	122,399.89	0.64
5	EXELON CORP	EXC US	52,456.70	0.28
6	FORTIVE CORP - W/I	FTV-W US	41,349.13	0.22

7	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	26,558.04	0.14
8	AT&T INC	T US	23,653.57	0.12
9	TARGET CORP	TGT US	21,495.25	0.11
10	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	20,253.24	0.11
11	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	20,234.58	0.11
12	WAL-MART STORES INC	WMT US	19,940.45	0.10
13	SOUTHERN CO	SO US	18,568.17	0.10
14	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	17,874.09	0.09
15	CATERPILLAR INC	CAT US	17,657.26	0.09
16	ADVANSIX INC Equity	ASIX US	17,459.21	0.09
17	-	PCLN US	16,977.93	0.09
18	KINDER MORGAN INC	KMI US	16,893.33	0.09
19	EXXON MOBIL CORP	XOM US	16,452.16	0.09
20	AMAZON.COM INC	AMZN US	15,226.78	0.08

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。

## 8.6 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	11,146,737.55
卖出收入（成交）总额	1,235,969.89

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。

**8.7 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细**

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

注：本基金本报告期末未持有基金。

**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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	25,147.32
4	应收利息	2,332.74
5	应收申购款	1,031,733.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,059,213.12
---	----	--------------

#### 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

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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
5,067	7,061.49	10,001,888.88	27.95%	25,778,672.27	72.05%

### 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	6,928.27	0.02%

### 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（2011 年 3 月 30 日）基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	18,898,724.43
本报告期基金总申购份额	24,611,032.40
减:本报告期基金总赎回份额	7,729,195.68
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	35,780,561.15

## § 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

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）成善栋先生自 2016 年 11 月 24 日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

自 2016 年 12 月 27 日起，本基金管理人增聘程燕春先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 50,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 6 年。

## 11.6 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督部门稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
Morgan Stanley & Co Intl Plc		-12,382,707.44	100.00%	3,859.15	100.00%	-

注：1、本报告期内租用的证券公司交易单元没有发生变更。

#### 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：

- 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。

## 11.8 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变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 5 日

2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 8 日
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 11 日
4	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 14 日
5	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2016 年 1 月 20 日
6	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 28 日
7	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 29 日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 2 月 4 日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持金亚科技估值调整的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 2 月 26 日
10	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 2 月 26 日
11	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式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、证券日 报	2016 年 3 月 1 日
12	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 19 日
13	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 23 日
14	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 24 日
15	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 26 日
16	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 7 日
17	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 13 日
18	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下	上证报、中证报、	2016 年 4 月 15 日

	基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报	
19	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 21 日
20	长信基金管理有限责任公司关于网上直销支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 5 日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分开放式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、证券日 报	2016 年 5 月 11 日
22	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民生银行股份有限公司直销银行申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 12 日
23	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书 (2016 年第【1】号) 及摘要	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 13 日
24	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 14 日
25	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 26 日
26	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 31 日
27	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 3 日
28	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 3 日
29	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 14 日
30	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陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投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	2016 年 6 月 16 日
31	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 16 日
32	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网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 28 日
33	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 30 日

34	长信基金管理有限责任公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及参加认购、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	2016 年 7 月 5 日
35	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 5 日
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司认购、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	2016 年 7 月 12 日
37	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 13 日
38	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加和讯信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 18 日
39	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 20 日
40	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 27 日
41	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 28 日
42	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加广发证券股份有限公司申购(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	2016 年 7 月 28 日
43	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 30 日
44	长信基金管理有限责任公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分开放式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、证券日报	2016 年 8 月 18 日
45	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杭州银行股份有限公司网上银行、手机银行等渠道基金申购(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、证券日报	2016 年 8 月 24 日
46	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告及摘要	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 26 日
47	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加长江证券股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2016 年 9 月 1 日
48	长信基金管理有限责任公司关于长信美国	上证报、中证报、	2016 年 9 月 1 日

	标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	证券时报	
49	长信基金管理有限责任公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加认购、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、证券日 报	2016 年 9 月 12 日
50	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	2016 年 9 月 20 日
51	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 9 月 29 日
52	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 10 月 14 日
53	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 10 月 19 日
54	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 10 月 24 日
55	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招商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	2016 年 10 月 27 日
56	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浙江同花顺基金销售有限公司基金认购、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	2016 年 10 月 27 日
57	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 11 月 9 日
58	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书 (2016 年第【2】号) 及摘要	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 11 月 12 日
59	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 11 月 15 日
60	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 11 月 22 日
61	长信基金管理有限责任公司关于 2016 年公	上证报、中证报、	2016 年 11 月 23 日

	司董事变更的公告	证券时报、证券日报	
62	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 11 月 23 日
63	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 11 月 24 日
64	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	2016 年 11 月 29 日
65	长信基金管理有限责任公司关于调整旗下开放式基金在蚂蚁金融服务集团销售平台申购金额下限的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 1 日
66	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	2016 年 12 月 6 日
67	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 6 日
68	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 17 日
69	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	2016 年 12 月 20 日
70	长信基金管理有限责任公司关于董事变更的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 21 日
71	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 22 日
72	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	2016 年 12 月 22 日
73	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 27 日
74	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2017 年开放日的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 29 日
75	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2016 年 12 月 29 日
76	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金及基	上证报、中证报、证券时报	2016 年 12 月 29 日

	金组合申购 (含定期定额投资申购) 费率优惠活动的公告		
77	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	2016 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强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。

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 13.3 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 3 月 27 日