

长信量化中小盘股票型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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	3,693,082,074.66 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	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	130,517,833.64	157,043,629.13
本期利润	-79,947,785.52	192,305,977.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0803	0.5815
本期基金份额净值增长率	3.76%	42.40%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0743	0.3257
期末基金资产净值	3,974,097,827.47	291,994,381.68
期末基金份额净值	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。

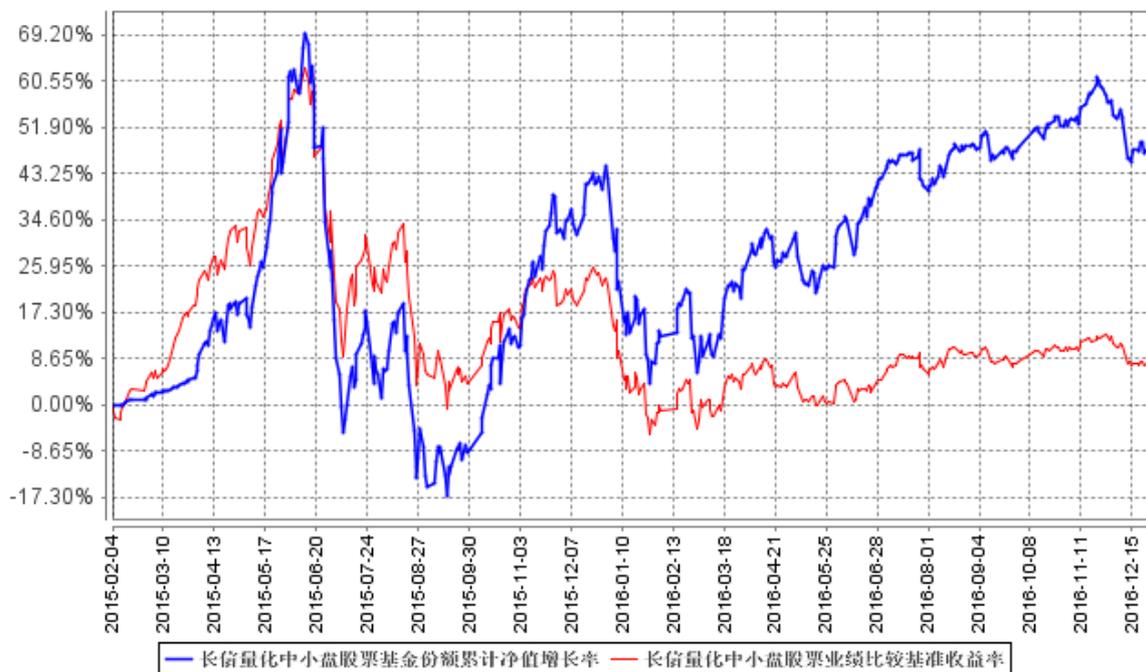
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.28%	0.95%	-0.88%	0.60%	0.60%	0.35%
过去六个月	3.68%	0.92%	2.29%	0.67%	1.39%	0.25%
过去一年	3.76%	1.85%	-12.37%	1.36%	16.13%	0.49%
自基金合同生效起至今	47.75%	2.34%	7.28%	1.78%	40.47%	0.56%

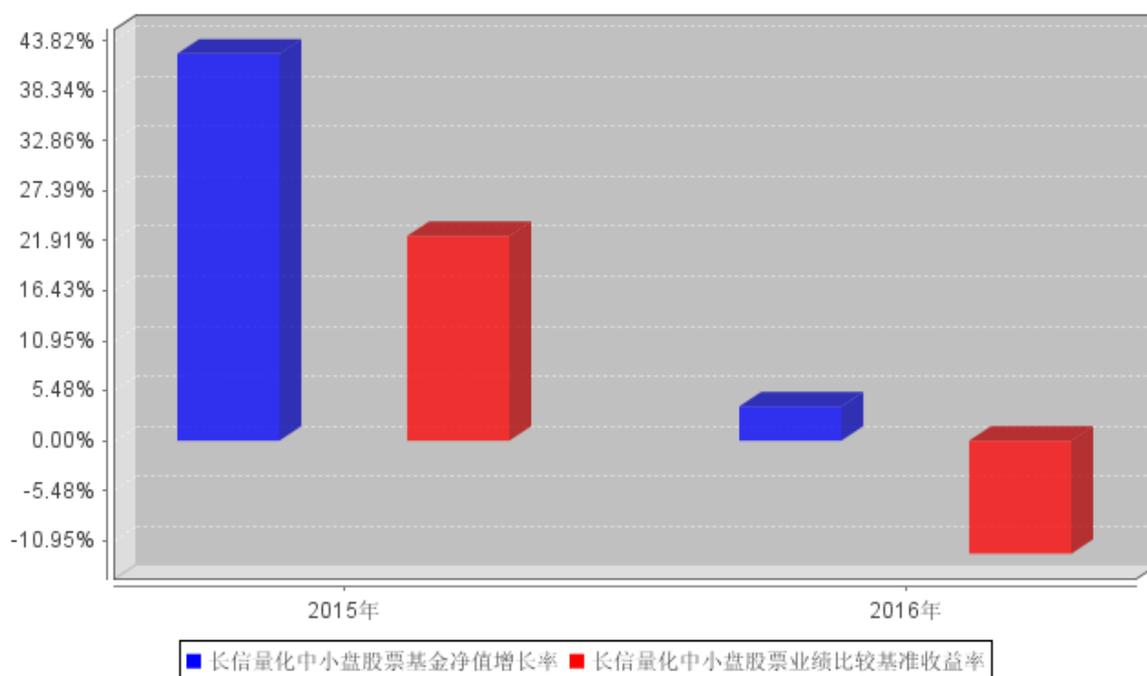
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2015 年 2 月 4 日至 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
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 1.5 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		
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和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理	2015年3月14日	-	6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和长信先利半年定期开放混合型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 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 2016 年 12 月 31 日，本基金净值为 1.076 元，本报告期间实现基金分红一次，本报告期内基金净值增长率为 3.76%，同期业绩比较基准收益率为-12.37%。

本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小盘股票。回顾 2016 年，A 股市场在经历 2015 年下半年和 2016 年初多轮大幅调整后回落至近年来的低位水平，2 月以后基本呈现出震荡上行的走势。1 月各种负面因素叠加使得市场的恐慌情绪快速释放，各类指数在 1 月份急转直下，中小市值成长股回调幅度较大；至 3 月份，受益于注册制的延后和战新板的搁置，成长股领先市场开启震荡上行的走势。在此期间，英国脱欧、美国总统大选、美联储加息预期等“黑天鹅”事件加剧了市场不确定性，投资者风险偏好很难有所提升，投资热点分散、市场风格切换频繁等特征十分明显。直至四季度，避险情绪升温，股市再受打压，以中小创为代表的成长股回撤较大。全年而言，上证综指收益率为-12.31%，沪深 300 指数收益率为-11.28%，中证 500 指数收益率为-17.78%，中小板综指收益率为-14.89%，创业板综指收益率为-20.35%，各类宽基指数回调幅度均较大。在投资中，本基金借助量化投资模型精选个股，在各类指数回调情况下全年实现净值涨幅 3.76%，为投资者创造了良好的相对和绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.076 元，份额累计净值为 1.476 元，本报告期

内本基金净值增长率为 3.76%，同期业绩比较基准收益率为-12.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2017 年美联储继续加息预期强烈，加之人民银行全面上调中期利率，货币政策收紧态势更为明显，在未有显著利好情绪或增量资金进入股市的情况下，大概率会延续震荡走势。

4.6 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。

4.7 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，本基金本报告期进行了一次利润分配，具体情况如下：

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	4.000	613,891,703.62	75,657,569.65	689,549,273.27	
合计	4.000	613,891,703.62	75,657,569.65	689,549,273.27	

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

2016 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

2016 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。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配,分配金额为 689,549,273.27 元,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

2016 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 2016 年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振字第 1700190 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	218,698,050.57	46,885,875.07
结算备付金	441,988,463.83	705,314.03
存出保证金	839,852.14	169,912.96
交易性金融资产	3,335,433,370.40	255,474,138.23
其中：股票投资	3,335,433,370.40	255,474,138.23
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	254,231.50	12,565.55
应收股利	-	-
应收申购款	15,823,688.32	1,376,994.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,013,037,656.76	304,624,800.03
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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	16,681,263.72	8,536,602.24
应付赎回款	12,008,551.52	3,067,846.45
应付管理人报酬	5,040,530.25	351,897.32
应付托管费	840,088.38	58,649.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,960,254.72	300,210.61
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	409,140.70	315,212.17
负债合计	38,939,829.29	12,630,418.35
所有者权益：		
实收基金	3,693,082,074.66	204,999,315.96
未分配利润	281,015,752.81	86,995,065.72
所有者权益合计	3,974,097,827.47	291,994,381.68
负债和所有者权益总计	4,013,037,656.76	304,624,800.03

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.076元，基金份额总额3,693,082,074.66份。

2、本基金本报告期为2016年1月1日至2016年12月31日，本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

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：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	上年度可比期间 2015年2月4日(基金合 同生效日)至2015年12月 31日
一、收入	-49,807,286.32	203,217,870.56
1. 利息收入	2,682,816.71	1,957,021.25
其中：存款利息收入	2,619,724.55	1,627,719.07
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	63,092.16	329,302.18
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	152,201,459.01	162,025,572.72
其中：股票投资收益	151,169,359.20	160,650,398.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	1,032,099.81	1,375,174.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-210,465,619.16	35,262,348.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,774,057.12	3,972,928.33
减：二、费用	30,140,499.20	10,911,893.17
1. 管理人报酬	17,000,299.63	5,130,990.12
2. 托管费	2,833,383.24	855,165.09
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,905,778.13	4,595,089.29
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	401,038.20	330,648.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-79,947,785.52	192,305,977.39
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-79,947,785.52	192,305,977.39

注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 4 日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

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：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）	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变动（净值减少以“-”号填列）	-	-689,549,273.27	-689,549,273.27
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
项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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）	869,346,402.40	-	869,346,402.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	192,305,977.39	192,305,977.39
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）	-664,347,086.44	-105,310,911.67	-769,657,998.11
其中：1. 基金申购款	248,498,721.04	75,201,431.14	323,700,152.18
2. 基金赎回款	-912,845,807.48	-180,512,342.81	-1,093,358,150.29
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）	204,999,315.96	86,995,065.72	291,994,381.68

注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 4 日起正式生效，上年度可比期间不满一个会计年度。

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”）已于 2012 年 3 月 27 日获中国证监会《关于核准长信量化中小盘股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]402 号）核准募集。为保护投资者利益，基金管理人于 2012 年 8 月 23 日向中国证监会提交了《长信基金管理有限责任公司关于推迟长信量化中小盘股票型证券投资基金募集时间的申请》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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》”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，对本基金进行变更注册。变更注册后的本基金于 2014 年 12 月 15 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1360 号文准予注册。本基金合同于 2015 年 2 月 4 日正

式生效。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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

本基金募集期自 2015 年 1 月 12 日至 2015 年 1 月 30 日止。经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集长信量化中小盘股票型证券投资基金(含利息结转份额) 869,346,402.40 份基金份额，有效认购户数为 7,776 户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化中小盘股票型证券投资基金招募说明书》(更新)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%。

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 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未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[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会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[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [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》、财税[2015]125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c)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。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

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。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h)对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	基金管理人
交通银行股份有限公司	基金托管人
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

7.4.8 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月4日(基金合同生效日)至2015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	942,496,068.05	11.42%	1,276,279,997.81	39.51%

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年2月4日(基金合同生效日)至2015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	-	-	1,400,000,000.00	70.00%

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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2015年2月4日(基金合同生效日)至2015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	1,048,052.07	39.49%	283,933.06	94.58%

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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年2月4日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	17,000,299.63
其中：支付销售机构的客户维护费	3,927,407.76	2,455,661.38

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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年2月4日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	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	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年2月4日(基金合同生效日)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
交通银行股份有限公司	218,698,050.57	1,769,993.99	46,885,875.07	763,908.32

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的结算备付金，于2016年12月31日的相关余额为人民币441,988,463.83元。(2015年12月31日：人民币705,314.03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。

7.4.9 期末（2016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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项	38.52	-	-	1,555,026	58,202,946.87	59,899,601.52	-
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项	177.97	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300526	中潜股份	2016年12月7日	重大事项	107.03	-	-	84	882.00	8,990.52	-
002509	天广中茂	2016年9月21日	重大事项	12.68	-	-	120	1,214.52	1,521.60	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大事项	15.84	2017年1月13日	14.26	23	331.65	364.32	-

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	3,335,433,370.40	83.11
	其中：股票	3,335,433,370.40	83.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	660,686,514.40	16.46
7	其他各项资产	16,917,771.96	0.42
8	合计	4,013,037,656.76	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港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	94,732,788.15	2.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,569,561,050.19	64.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	114,170,323.00	2.87
E	建筑业	59,816,220.23	1.51
F	批发和零售业	92,781,359.78	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	59,591,182.70	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	222,745,919.32	5.60
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	59,941,264.23	1.51
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	-	-
S	综合	61,986,482.80	1.56
	合计	3,335,433,370.40	83.93

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过沪港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	300194	福安药业	3,762,807	98,961,824.10	2.49
2	300138	晨光生物	5,281,113	96,274,689.99	2.42
3	002321	华英农业	8,845,265	94,732,788.15	2.38
4	600178	东安动力	8,541,813	94,301,615.52	2.37
5	000705	浙江震元	7,084,588	92,595,565.16	2.33
6	600589	广东榕泰	10,451,493	91,450,563.75	2.30
7	002593	日上集团	12,406,725	91,313,496.00	2.30
8	002507	涪陵榨菜	6,731,400	90,066,132.00	2.27
9	300303	聚飞光电	10,072,586	88,840,208.52	2.24
10	002472	双环传动	7,660,568	86,870,841.12	2.19

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	002507	涪陵榨菜	112,770,201.06	38.62
2	000705	浙江震元	100,483,682.93	34.41
3	600178	东安动力	99,633,385.46	34.12
4	600589	广东榕泰	99,042,600.73	33.92
5	300303	聚飞光电	98,126,853.03	33.61

6	002472	双环传动	97,611,700.99	33.43
7	002593	日上集团	95,996,357.08	32.88
8	002321	华英农业	93,716,414.81	32.10
9	300138	晨光生物	92,449,067.49	31.66
10	300194	福安药业	89,345,764.71	30.60
11	000978	桂林旅游	82,807,873.56	28.36
12	300241	瑞丰光电	76,447,535.80	26.18
13	002585	双星新材	75,301,375.78	25.79
14	300262	巴安水务	74,079,095.29	25.37
15	002403	爱仕达	73,480,569.39	25.17
16	002438	江苏神通	73,453,730.21	25.16
17	600429	三元股份	73,282,048.49	25.10
18	002390	信邦制药	72,103,407.78	24.69
19	002580	圣阳股份	71,040,861.64	24.33
20	300193	佳士科技	70,884,937.48	24.28
21	000548	湖南投资	70,044,537.63	23.99
22	002452	长高集团	69,987,018.99	23.97
23	002253	川大智胜	69,669,086.76	23.86
24	300287	飞利信	69,353,015.76	23.75
25	300256	星星科技	69,285,277.77	23.73
26	300141	和顺电气	66,737,539.40	22.86
27	300065	海兰信	66,606,315.83	22.81
28	000766	通化金马	66,512,283.36	22.78
29	300048	合康新能	65,974,305.10	22.59
30	002365	永安药业	65,389,788.30	22.39
31	300294	博雅生物	65,165,571.03	22.32
32	300283	温州宏丰	64,809,014.52	22.20
33	002370	亚太药业	63,948,105.06	21.90
34	300046	台基股份	63,900,891.22	21.88
35	002218	拓日新能	63,741,736.32	21.83
36	300306	远方光电	63,388,937.67	21.71
37	600461	洪城水业	62,712,669.96	21.48
38	000938	紫光股份	62,672,369.79	21.46
39	300031	宝通科技	62,363,847.05	21.36
40	000004	国农科技	62,189,302.99	21.30
41	000636	风华高科	61,544,076.27	21.08

42	300035	中科电气	61,428,660.96	21.04
43	000551	创元科技	61,137,027.70	20.94
44	600679	上海凤凰	60,635,848.99	20.77
45	002497	雅化集团	60,364,027.29	20.67
46	002529	海源机械	60,183,755.93	20.61
47	300158	振东制药	60,127,806.54	20.59
48	300335	迪森股份	59,575,398.29	20.40
49	002193	山东如意	59,370,719.09	20.33
50	002139	拓邦股份	58,563,297.49	20.06
51	002661	克明面业	58,163,871.12	19.92
52	002637	赞宇科技	57,572,835.48	19.72
53	300209	天泽信息	56,174,079.90	19.24
54	300341	麦迪电气	54,303,825.49	18.60
55	300250	初灵信息	52,190,485.83	17.87
56	002660	茂硕电源	48,743,339.24	16.69
57	002523	天桥起重	46,667,532.29	15.98
58	002607	亚夏汽车	43,974,440.13	15.06
59	300079	数码视讯	42,951,269.55	14.71
60	002487	大金重工	42,594,537.63	14.59
61	002086	东方海洋	40,343,597.32	13.82
62	002726	龙大肉食	40,342,049.54	13.82
63	300098	高新兴	33,992,820.52	11.64
64	300008	天海防务	33,882,803.37	11.60
65	300049	福瑞股份	33,657,154.01	11.53
66	600537	亿晶光电	33,318,162.35	11.41
67	000989	九芝堂	32,782,954.02	11.23
68	300377	赢时胜	32,765,317.15	11.22
69	300245	天玑科技	32,722,751.71	11.21
70	002410	广联达	32,591,025.14	11.16
71	000591	太阳能	32,333,674.74	11.07
72	002675	东诚药业	31,795,873.63	10.89
73	002188	巴士在线	31,526,710.58	10.80
74	300292	吴通控股	30,689,741.98	10.51
75	002322	理工环科	30,485,878.52	10.44
76	300183	东软载波	30,327,296.94	10.39
77	002677	浙江美大	29,468,363.15	10.09

78	000667	美好置业	28,830,770.99	9.87
79	300267	尔康制药	28,809,129.72	9.87
80	002196	方正电机	28,544,602.52	9.78
81	300018	中元股份	28,283,299.92	9.69
82	002449	国星光电	27,800,265.44	9.52
83	600644	乐山电力	26,847,883.02	9.19
84	600505	西昌电力	26,786,722.82	9.17
85	002719	麦趣尔	26,666,646.30	9.13
86	300063	天龙集团	26,600,931.57	9.11
87	000070	特发信息	26,419,076.95	9.05
88	002722	金轮股份	25,085,229.14	8.59
89	300206	理邦仪器	23,609,474.72	8.09
90	300103	达刚路机	20,280,709.36	6.95
91	300121	阳谷华泰	19,552,194.25	6.70
92	300214	日科化学	19,382,186.96	6.64
93	000635	英力特	19,313,395.21	6.61
94	300062	中能电气	18,736,504.79	6.42
95	002567	唐人神	18,735,171.21	6.42
96	600419	天润乳业	18,658,386.24	6.39
97	002020	京新药业	16,992,263.08	5.82
98	300373	扬杰科技	15,928,981.11	5.46
99	300165	天瑞仪器	15,714,025.30	5.38
100	000609	绵石投资	15,649,498.10	5.36
101	300259	新天科技	15,480,960.14	5.30
102	300319	麦捷科技	13,997,716.96	4.79
103	000599	青岛双星	13,805,067.29	4.73
104	300211	亿通科技	13,111,375.28	4.49
105	300172	中电环保	12,795,081.68	4.38
106	600757	长江传媒	12,447,374.94	4.26
107	300200	高盟新材	12,279,722.24	4.21
108	300042	朗科科技	12,168,215.76	4.17
109	002502	骅威文化	12,138,897.75	4.16
110	002545	东方铁塔	11,903,026.78	4.08
111	002509	天广中茂	11,741,214.08	4.02
112	002137	麦达数字	11,617,104.64	3.98
113	300387	富邦股份	11,494,823.32	3.94

114	600393	粤泰股份	11,247,375.62	3.85
115	300301	长方集团	10,496,940.44	3.59
116	002380	科远股份	10,402,778.02	3.56
117	300365	恒华科技	10,342,416.42	3.54
118	300381	溢多利	9,958,522.60	3.41
119	000429	粤高速A	9,847,543.99	3.37
120	300143	星河生物	8,860,098.38	3.03
121	300071	华谊嘉信	8,851,376.32	3.03
122	002087	新野纺织	8,699,905.00	2.98
123	300184	力源信息	8,640,112.96	2.96
124	300279	和晶科技	8,465,382.00	2.90
125	300182	捷成股份	8,339,955.49	2.86
126	300317	珈伟股份	8,253,489.98	2.83
127	300119	瑞普生物	7,504,734.36	2.57
128	300345	红宇新材	6,946,182.81	2.38
129	300069	金利华电	6,543,237.24	2.24
130	300230	永利股份	6,298,902.47	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。

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	600679	上海凤凰	84,008,568.85	28.77
2	002580	圣阳股份	69,147,493.48	23.68
3	300250	初灵信息	60,809,892.41	20.83
4	300341	麦迪电气	54,953,052.68	18.82
5	002523	天桥起重	52,040,565.11	17.82
6	002660	茂硕电源	48,703,930.78	16.68
7	002086	东方海洋	47,262,043.62	16.19
8	002726	龙大肉食	47,091,265.88	16.13
9	002487	大金重工	46,303,664.72	15.86
10	002607	亚夏汽车	45,176,188.43	15.47
11	300079	数码视讯	42,705,555.79	14.63
12	002722	金轮股份	42,691,433.00	14.62
13	300292	吴通控股	37,672,182.00	12.90
14	002322	理工环科	36,701,990.78	12.57

15	300018	中元股份	36,266,928.40	12.42
16	300098	高新兴	35,581,121.64	12.19
17	300183	东软载波	34,306,598.51	11.75
18	300267	尔康制药	33,046,977.08	11.32
19	300377	赢时胜	33,012,353.23	11.31
20	600537	亿晶光电	32,693,408.38	11.20
21	300049	福瑞股份	32,632,383.86	11.18
22	002719	麦趣尔	32,107,425.33	11.00
23	300245	天玑科技	32,016,901.61	10.96
24	000989	九芝堂	31,736,642.95	10.87
25	002410	广联达	31,265,433.75	10.71
26	300008	天海防务	31,230,005.91	10.70
27	002675	东诚药业	31,215,610.01	10.69
28	000667	美好置业	31,120,689.00	10.66
29	300063	天龙集团	30,945,392.07	10.60
30	000591	太阳能	30,923,615.24	10.59
31	002188	巴士在线	30,636,923.86	10.49
32	002196	方正电机	30,069,522.68	10.30
33	000070	特发信息	29,359,052.22	10.05
34	600505	西昌电力	29,303,469.81	10.04
35	002677	浙江美大	29,108,596.41	9.97
36	002449	国星光电	28,700,187.22	9.83
37	600644	乐山电力	28,174,810.02	9.65
38	300206	理邦仪器	25,483,422.93	8.73
39	300121	阳谷华泰	23,473,905.84	8.04
40	300214	日科化学	23,393,355.95	8.01
41	600419	天润乳业	22,068,156.76	7.56
42	000635	英力特	20,385,838.70	6.98
43	300103	达刚路机	20,336,258.16	6.96
44	002567	唐人神	19,597,228.69	6.71
45	002507	涪陵榨菜	19,299,543.39	6.61
46	000978	桂林旅游	19,008,068.80	6.51
47	300062	中能电气	18,617,925.29	6.38
48	300301	长方集团	17,889,652.18	6.13
49	300259	新天科技	17,552,028.46	6.01
50	300373	扬杰科技	17,310,223.26	5.93
51	000609	绵石投资	16,932,941.34	5.80
52	300319	麦捷科技	16,868,328.78	5.78

53	000429	粤高速 A	16,795,161.15	5.75
54	002020	京新药业	16,466,355.34	5.64
55	002545	东方铁塔	16,373,544.91	5.61
56	002585	双星新材	15,858,700.82	5.43
57	000599	青岛双星	14,961,012.23	5.12
58	002087	新野纺织	14,788,950.44	5.06
59	002380	科远股份	14,265,507.70	4.89
60	002438	江苏神通	14,015,005.56	4.80
61	300365	恒华科技	13,910,339.75	4.76
62	300172	中电环保	13,538,968.12	4.64
63	300042	朗科科技	13,401,905.58	4.59
64	300387	富邦股份	13,358,408.25	4.57
65	002509	天广中茂	13,270,497.04	4.54
66	300211	亿通科技	12,946,844.20	4.43
67	600757	长江传媒	12,919,802.52	4.42
68	002502	骅威文化	12,899,403.90	4.42
69	002403	爱仕达	12,818,141.38	4.39
70	300200	高盟新材	12,803,655.74	4.38
71	600429	三元股份	12,751,305.25	4.37
72	002137	麦达数字	12,308,583.93	4.22
73	300241	瑞丰光电	12,246,761.43	4.19
74	300119	瑞普生物	12,160,942.54	4.16
75	300310	宜通世纪	11,906,228.01	4.08
76	002452	长高集团	11,846,430.00	4.06
77	002365	永安药业	11,775,969.30	4.03
78	300193	佳士科技	11,623,552.55	3.98
79	600393	粤泰股份	11,444,714.30	3.92
80	002390	信邦制药	10,350,412.50	3.54
81	300262	巴安水务	10,339,551.50	3.54
82	000548	湖南投资	10,158,179.09	3.48
83	300182	捷成股份	9,873,796.21	3.38
84	300143	星河生物	9,549,833.30	3.27
85	300345	红宇新材	9,433,998.29	3.23
86	300317	珈伟股份	9,124,925.33	3.13
87	300065	海兰信	8,932,757.80	3.06
88	300127	银河磁体	8,720,361.04	2.99
89	300381	溢多利	8,703,304.94	2.98
90	300279	和晶科技	8,550,195.98	2.93

91	300071	华谊嘉信	8,486,897.20	2.91
92	002532	新界泵业	8,473,145.71	2.90
93	300184	力源信息	8,194,750.54	2.81
94	000949	新乡化纤	8,115,525.32	2.78
95	002255	海陆重工	7,992,643.85	2.74
96	002606	大连电瓷	7,764,625.54	2.66
97	002511	中顺洁柔	7,456,959.02	2.55
98	300069	金利华电	7,077,385.80	2.42
99	300173	智慧松德	6,971,902.74	2.39
100	600727	鲁北化工	6,570,708.62	2.25
101	300230	永利股份	6,563,731.26	2.25
102	000903	云内动力	6,398,559.50	2.19
103	002212	南洋股份	6,241,601.80	2.14
104	002579	中京电子	5,882,836.03	2.01

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	5,699,051,262.85
卖出股票收入（成交）总额	2,559,795,770.72

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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	839,852.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	254,231.50
5	应收申购款	15,823,688.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,917,771.96
---	----	---------------

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
66,260	55,736.22	1,898,287,152.42	51.40%	1,794,794,922.24	48.60%

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	1,411,859.08	0.04%

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	204,999,315.96
本报告期基金总申购份额	4,496,119,206.48
减:本报告期基金总赎回份额	1,008,036,447.78
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	3,693,082,074.66

§ 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

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 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；报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 2 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

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
兴业证券	2	1,671,717,475.46	20.26%	1,389,702.48	21.01%	
安信证券	1	1,448,534,472.94	17.56%	769,609.76	11.64%	
国泰君安	1	1,173,189,363.05	14.22%	1,092,593.87	16.52%	
长江证券	2	942,496,068.05	11.42%	812,156.67	12.28%	
中泰证券	1	635,274,307.12	7.70%	528,104.27	7.98%	
华泰证券	2	558,573,280.09	6.77%	459,538.94	6.95%	
华创证券	1	484,706,912.26	5.87%	451,407.76	6.82%	
海通证券	1	412,949,313.07	5.00%	343,285.11	5.19%	
光大证券	1	411,789,148.24	4.99%	342,315.98	5.18%	
广发证券	2	400,137,608.01	4.85%	332,634.79	5.03%	
国金证券	1	111,520,290.60	1.35%	92,704.66	1.40%	
天风证券	1	-	-	-	-	
中银国际证 券	1	-	-	-	-	
爱建证券	1	-	-	-	-	
东方证券	1	-	-	-	-	
申银万国	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	

注：1、本报告期内本基金增加租用爱建证券的交易单元 1 个，安信证券的交易单元 1 个，东方证

券的交易单元 1 个，平安证券的交易单元 1 个，中银国际证券的交易单元 1 个，中泰证券的交易单元 1 个，天风证券的交易单元 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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

2017年3月27日