

长信量化多策略股票型证券投资基金 2017年年度报告

2017年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018年3月31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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于2018年3月26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2017年1月1日起至2017年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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
§5 托管人报告	19
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
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	22
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	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
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	59

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.....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
8.12 投资组合报告附注.....	60
§ 9 基金份额持有人信息.....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§ 10 开放式基金份额变动.....	63
§ 11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	64
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
11.9 其他重大事件.....	66
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况.....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	长信量化多策略股票	
场内简称	量化策略	
基金主代码	519965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月14日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,133,973.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
下属分级基金的场内简称:	量化策略A	量化策略C
下属分级基金的交易代码:	519965	004858
报告期末下属分级基金的份额总额	160,922,331.02份	211,642.78份

注：基金管理人决定自2017年7月20日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额，具体事宜可详见基金管理人于2017年7月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
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和债券型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	郭明
	联系电话	021-61009999	010-66105799
	电子邮箱	zhouyg@icxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105798
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55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55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	成善栋	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、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、北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路222号30楼
A类注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
C类注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路68号9楼

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年		2016年		2015年7月14日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
本期已实现收益	-10,682,004.19	-6,777.73	22,727,556.05	-	45,473,837.81	-
本期利润	-8,698,531.34	-5,948.29	6,411,645.13	-	58,330,534.91	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0406	-0.0455	0.0571	-	0.1616	-
本期加权平均净值利润率	-3.26%	-3.60%	4.90%	-	16.60%	-
本期基金份额净值增长率	-1.73%	3.66%	4.19%	-	21.80%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配利润	39,808,923.22	41,217.62	44,423,752.10	-	19,909,591.19	-
期末可供分配基金份额利润	0.2474	0.1948	0.2693	-	0.2182	-
期末基金资产净值	200,731,254.24	263,481.22	209,410,792.22	-	111,142,362.97	-
期末基金份额净值	1.247	1.245	1.269	-	1.218	-
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末		2015年末	
基金份额累计净值增长率	24.70%	3.66%	26.90%	-	21.80%	-

注：1、长信量化多策略股票型证券投资基金C份额增加日为2017年7月20日，根据管理人于2017年7月20日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金C类基金份额净值计算与披露方法的说明》，任何一个工作日C类基金份额为零时，本基金将停止计算C类基金份额净值，暂停计算期间的C类基金份额净值将按照A类基金份额净值披露，作为参考份额净值；截至本报告期末，长信量化多策略股票型证券投资基金C份额运作时间未满一年；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

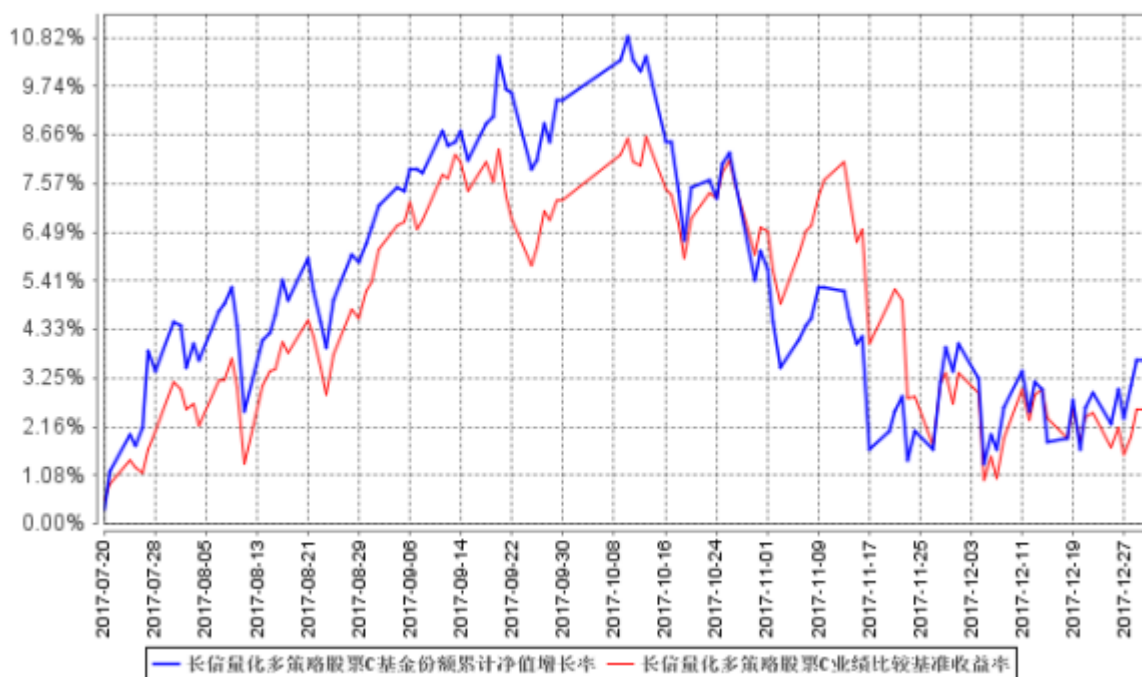
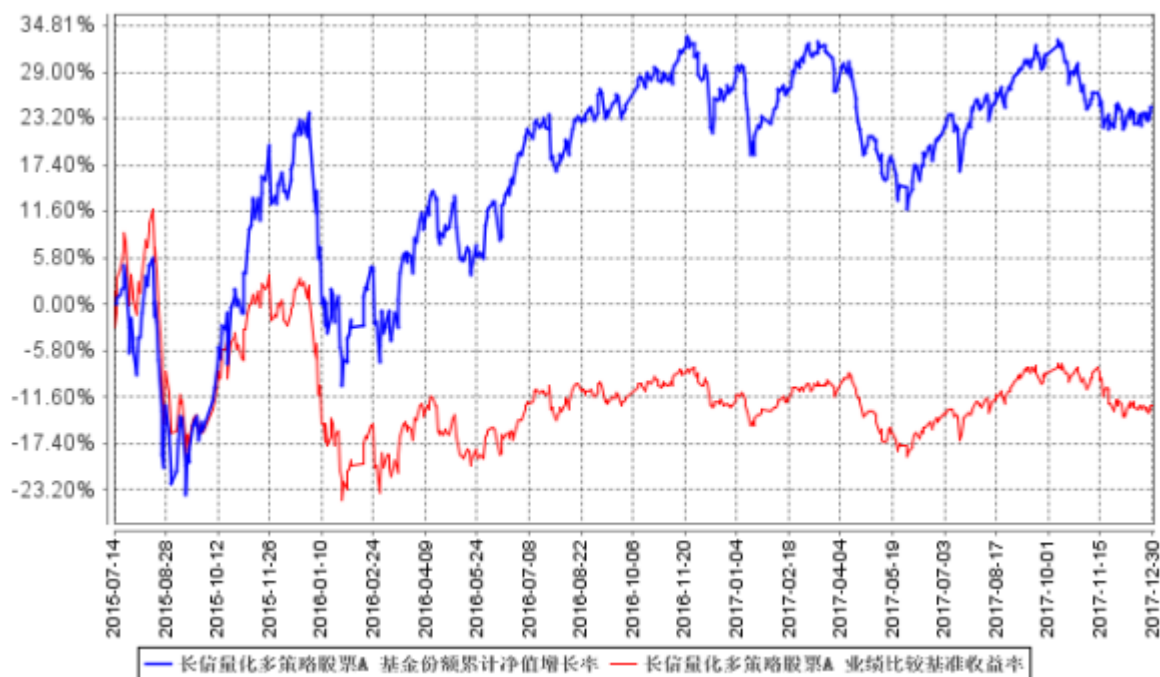
长信量化多策略股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.95%	0.83%	-4.34%	0.79%	-0.61%	0.04%
过去六个月	2.97%	0.87%	1.59%	0.77%	1.38%	0.10%
过去一年	-1.73%	0.96%	0.06%	0.74%	-1.79%	0.22%
自基金合同生效起至今	24.70%	1.78%	-12.68%	1.50%	37.38%	0.28%

长信量化多策略股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.25%	0.84%	-4.34%	0.79%	-0.91%	0.05%
自份额增加日起至今	3.66%	0.79%	2.57%	0.72%	1.09%	0.07%

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

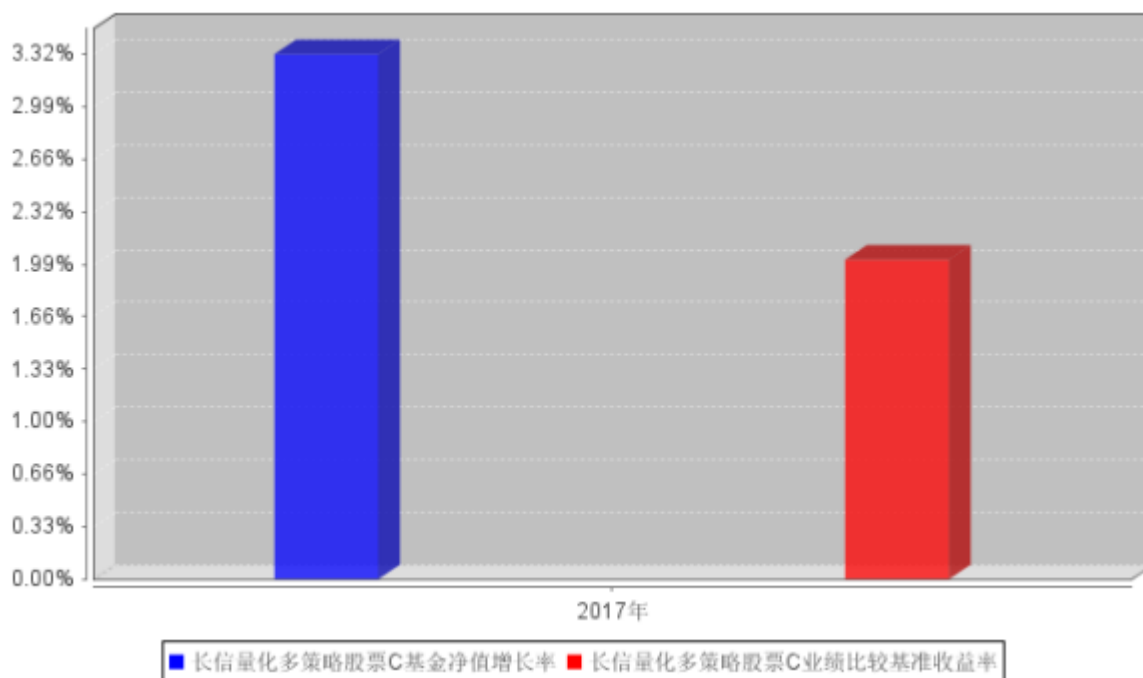
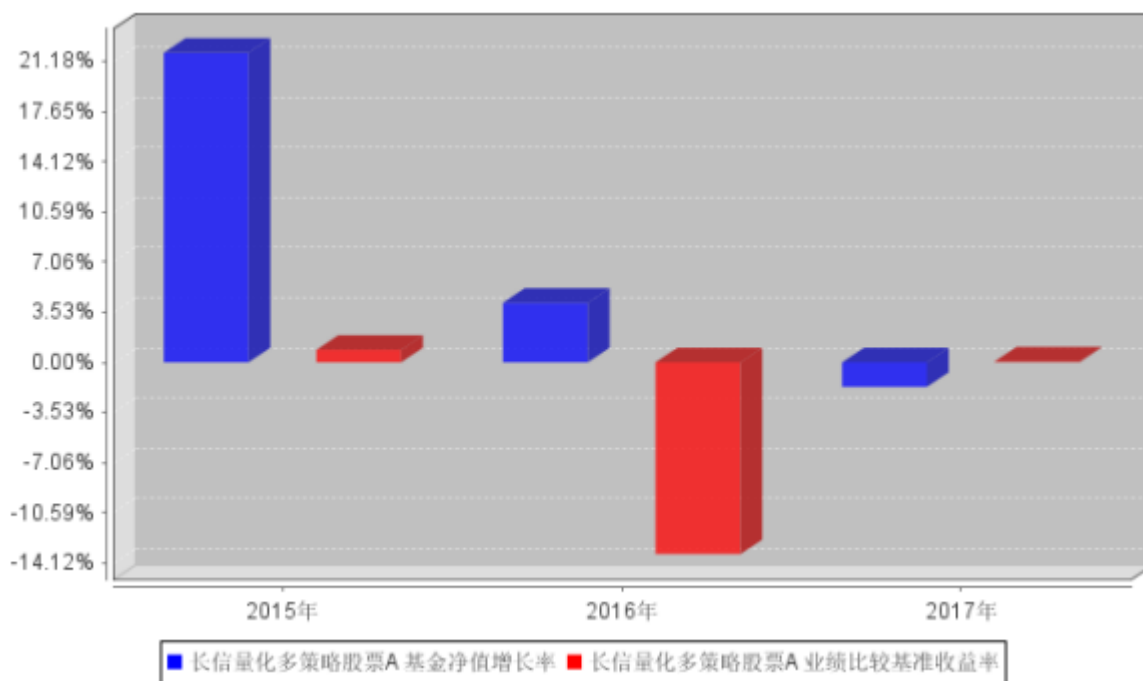


注：1、基金管理人自2017年7月20日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额。

2、长信量化策略A图示日期为2015年7月14日至2017年12月31日，长信量化策略C图示日期为2017年7月20日（份额增加日）至2017年12月31日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

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：长信量化策略C图示份额计算期间为自份额增加日2017年7月20日至2017年12月31日，2017年净值增长率按长信量化策略C份额实际存续期计算。

长信量化策略A份额过去三年计算期间为基金合同生效日为2015年7月14日至2017年12月31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

注：本基金基金合同生效日为2015年7月14日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§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1.65亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占4.54%。

截至2017年12月31日，本基金管理人共管理58只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基

金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证500指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常松	长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理、总经理助理、混合策略部总监。	2015年9月25日	-	16年	管理学博士，东南大学管理科学与工程专业博士生毕业，具有基金从业资格。曾任富国基金管理有限公司研究员，北京尊嘉资产管理有限公司投资经理，中原证券股份有限公司投资主办，2015年4月加入长信基金管理有限责任公司，现任总经理助理、混合策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。
左金保	长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先	2015年7月14日	-	7年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和 risk 与绩效评估研究员，现任量化投资部总监、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活

	锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（原长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF））和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监			配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）（原长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF））和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理。
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

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

3、自2018年2月6日起，左金保不再担任长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理；

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

回顾2017年，A股市场大小盘风格分化显著。代表大盘蓝筹股的上证50和沪深300指数持续上涨，累计收益率分别为25.1%、21.8%；而代表中盘和小盘股的中证500、中证1000指数走势较弱，累计收益率则分别为-0.20%、-17.4%。2017年是改革大年，供给侧改革，金融监管和财税改革等改革政策全面展开，前三年的金融扩张期有所收缩，货币政策从宽松逐步走向中性偏紧，因此靠宽松的流动性带来的增加债务的加杠杆盈利模式难以为继，价值投资风格成为全年的投资主线，创造自由现金流的能力成为评估资产质量的核心。

从行业表现情况来看，下游行业基本面结构分化也较为明显，以食品饮料和家用电器为代表的白马股基本面表现优异，全年投资收益远超其他下游行业（商贸零售、纺织服装等）。从细分项上来看，空调、白酒及乳业表现更为出色。中游行业景气度出现拐点，行业增速开始下行。上游行业中一至四月螺纹钢、铁矿石、动力煤、焦煤等多数资源品价格有所回落，但受供给侧改革政策提振，五月至年末资源品价格出现反弹，库存同比持续下降，钢铁和煤炭企业盈利水平大幅提升，从全年来看，煤炭和钢铁行业涨幅居前。

本基金持股风格偏向中小盘股票，中小盘股票持续弱势是本基金表现不佳的主要原因。本基金A类份额期间净值涨幅-1.73%，涨幅小于本基金的业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，长信量化多策略股票A份额净值为1.247元，份额累计净值为1.247元，本报告期内长信量化多策略股票A净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准收益率为0.06%；长信量化多策略股票C份额净值为1.245元，份额累计净值为1.245元，本报告期内长信量化多策略股票C净值增长率为3.66%，同期业绩比较基准收益率为2.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从出口、投资、消费来看：出口在中周期由朱格拉周期决定，未来三年都不会太差；短周期由库存周期决定，未来两三个季度可能会经历一轮小幅放缓。投资倾向于认为2018年基建仍可能保持大致稳定；房地产投资将继续温和向下；制造业是明年看点之一，明年制造业投资将继续修复。2018年名义消费受CPI支撑，但实际消费受地产销售拖累。品牌消费、线上消费、乡村消费将是三大结构亮点。

从对翘尾和新涨价因素的分析来看，2018年CPI中枢大概率高于今年；通胀主线会从PPI转向CPI；通胀预期会升温，加息预期会存在。由于2018年名义增速回落且弹性变小，实际GDP亦小幅回落，整体性盈利的逻辑弱化；但名义GDP下行幅度并不足以触发通缩交易，所以认为可能是偏结构性机会。

我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年度，随着市场调整及政府职能以及监管方式的转换，强监管、重落实的监管要求进一步明确，对公司的合规及风险管理工作提出了更高的要求。在此情况下，本年度监察稽核工作主要围绕以下几个部分展开：

本年度，监察稽核部严把合规底线不动摇，及时、有效将各项监管要求传导到位并紧抓落实。对于新下发的法律法规的后续通报、分析、培训、制度修订、新业务风险评估与合规支持等工作，监察稽核部均能做到及时通报全员，融会贯通，并及时对公司的内部控制方式及制度进行调整。

本年度，监察稽核部在督察长的指导下，继续加强公司内部控制的体系建设，落实内控与风控防线的全面前置。在督察长的领导下开展了全面风险梳理与自查工作，并依据自查工作成果汇总整理更新了公司的风险地图，使公司各部门更加深刻地认识到内控制度对促进公司规范经营，

有效防范和化解风险，保障基金持有人利益等方面的重要性。为公司后续业务发展奠定了良好的合规基础。

本年度，监察稽核部着力于加强部门内部人员管理及风险管控，做好前、中、后台的协调和服务工作。监察稽核部密切关注监管部门法律法规及指导意见更新情况，对于新发法律法规的后续通报、分析、培训、制度修订、新业务风险评估与合规支持等工作，监察稽核部均能做到及时通报全员，融会贯通，并及时与业务部门进行沟通，对公司的内部控制方式及制度进行调整。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对长信量化多策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信量化多策略股票型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 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	德师报(审)字(18)第P00423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	长信量化多策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长信量化多策略股票型证券投资基金的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017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。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长信量化多策略股票型证券投资基金2017年12月31日的财务状况、2017年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信量化多策略股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长信量化多策略股票型证券投资基金2017年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信量化多策略股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信量化多策略股票型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长信量化多策略股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致

任	<p>的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长信量化多策略股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信量化多策略股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曾浩 吴凌志
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号30楼
审计报告日期	2018年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	28,241,670.99	36,289,468.45
结算备付金		969,568.84	914,876.66
存出保证金		80,806.10	42,683.56
交易性金融资产	7.4.7.2	172,951,723.60	177,441,468.82
其中：股票投资		172,951,723.60	177,441,468.82
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		400,638.13	-
应收利息	7.4.7.5	5,805.01	6,623.68
应收股利		-	-
应收申购款		96,040.28	867,963.42

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		202,746,252.95	215,563,084.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		523,236.06	3,981,124.65
应付赎回款		377,469.41	1,271,339.80
应付管理人报酬		255,187.84	252,784.17
应付托管费		42,531.30	42,130.71
应付销售服务费		215.33	-
应付交易费用	7.4.7.7	321,694.53	342,300.17
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	231,183.02	262,612.87

负债合计		1,751,517.49	6,152,292.37
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	161,133,973.80	164,987,040.12
未分配利润	7.4.7.10	39,860,761.66	44,423,752.10
所有者权益合计		200,994,735.46	209,410,792.22
负债和所有者权益总计		202,746,252.95	215,563,084.59

注：报告截止日2017年12月31日，长信量化多策略股票A份额净值人民币1.247元，基金份额总额160,922,331.02份；长信量化多策略股票C份额净值人民币1.245元，基金份额总额211,642.78份；总份额合计161,133,973.80份。

7.2 利润表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
一、收入		-1,396,693.62	10,181,074.85
1.利息收入		325,745.81	144,979.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	319,756.18	144,979.38
债券利息收入		20.18	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,969.45	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,002,305.63	25,919,963.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,485,831.88	25,310,546.53

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,391.21	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,484,917.46	609,416.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,984,302.29	-16,315,910.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,295,563.91	432,043.12
减：二、费用		7,307,786.01	3,769,429.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,007,763.97	1,951,545.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	667,960.63	325,257.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	752.75	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,400,674.66	1,232,628.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	230,634.00	259,998.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,704,479.63	6,411,645.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,704,479.63	6,411,645.13

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日
----	-----------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	164,987,040.12	44,423,752.10	209,410,792.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,704,479.63	-8,704,479.63
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）	-3,853,066.32	4,141,489.19	288,422.87
其中：1. 基金申购款	291,819,249.78	77,160,801.22	368,980,051.00
2. 基金赎回款	-295,672,316.10	-73,019,312.03	-368,691,628.13
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）	161,133,973.80	39,860,761.66	200,994,735.46
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	91,232,771.78	19,909,591.19	111,142,362.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,411,645.13	6,411,645.13
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）	73,754,268.34	18,102,515.78	91,856,784.12
其中：1. 基金申购款	192,412,768.52	42,188,799.61	234,601,568.13
2. 基金赎回款	-118,658,500.18	-24,086,283.83	-142,744,784.01
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）	164,987,040.12	44,423,752.10	209,410,792.22

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

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]742号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为648,523,672.21份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1500947号验资报告。基金合同于2015年7月14日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据2017年7月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》,从2017年7月20日起,本基金增设C类份额(以下简称“长信量化多策略股票C”),长信量化多策略股票C的年销售服务费率为1.00%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额(以下简称“长信量化多策略股票A”),长信量化多策略股票A不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80% - 95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例为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。本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率 \times 80%+中证综合债券指数收益率 \times 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年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

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价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或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。基金份额拆分引起的基金份额变动于份额拆分日按拆分前的基金份额数及确定的拆分比例，计算并增加基金份额数量。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视

同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

-投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代缴金额确认。

-公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的1.00%年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2、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相应类别的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、基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的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、同一类别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。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 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：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关固定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免营业税和增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(

含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	28,241,670.99	36,289,468.45
定期存款	-	-
其中:存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	28,241,670.99	36,289,468.45

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	174,426,635.13	172,951,723.60	-1,474,911.53
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	174,426,635.13	172,951,723.60	-1,474,911.53
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	180,900,682.64	177,441,468.82	-3,459,213.82
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	180,900,682.64	177,441,468.82	-3,459,213.82

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：本基金本报告期及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	5,332.41	6,192.78
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	436.30	411.70
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	36.30	19.20
合计	5,805.01	6,623.68

注：其他为应收保证金利息。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	321,694.53	342,300.17
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	321,694.53	342,300.17

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,183.02	2,612.87
预提费用	-	-
预提信息披露费	180,000.00	190,000.00
审计费	50,000.00	70,000.00
合计	231,183.02	262,612.87

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信量化多策略股票A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	164,987,040.12	164,987,040.12
本期申购	291,579,746.70	291,579,746.70
本期赎回（以“-”号填列）	-295,644,455.80	-295,644,455.80
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	160,922,331.02	160,922,331.02

金额单位：人民币元

长信量化多策略股票C		
项目	本期 2017年7月20日（份额增加日）至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	239,503.08	239,503.08
本期赎回（以“-”号填列）	-27,860.30	-27,860.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	211,642.78	211,642.78

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、基金管理人决定自2017年7月20日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额，具体事宜可详见基金管理人于2017年7月17日发布

的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长信量化多策略股票A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	87,214,879.60	-42,791,127.50	44,423,752.10
本期利润	-10,682,004.19	1,983,472.85	-8,698,531.34
本期基金份额交易产生的变动数	-803,740.22	4,887,442.68	4,083,702.46
其中：基金申购款	154,142,504.04	-77,047,407.74	77,095,096.30
基金赎回款	-154,946,244.26	81,934,850.42	-73,011,393.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,729,135.19	-35,920,211.97	39,808,923.22

单位：人民币元

长信量化多策略股票C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-6,777.73	829.44	-5,948.29
本期基金份额交易产生的变动数	47,995.35	9,791.38	57,786.73
其中：基金申购款	54,515.39	11,189.53	65,704.92
基金赎回款	-6,520.04	-1,398.15	-7,918.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,217.62	10,620.82	51,838.44

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	301,981.97	136,740.11
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	13,242.90	5,762.04
其他	4,531.31	2,477.23
合计	319,756.18	144,979.38

注：其他为保证金利息收入1,192.74元，申购款利息收入3,338.57元。

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	989,024,442.00	431,234,509.44
减：卖出股票成本总额	996,510,273.88	405,923,962.91
买卖股票差价收入	-7,485,831.88	25,310,546.53

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,391.21	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,391.21	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	97,628.97	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	99,000.00	-
减：应收利息总额	20.18	-
买卖债券差价收入	-1,391.21	-

7.4.7.13.3 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赎回差价收入。

7.4.7.13.4 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申购差价收入。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,484,917.46	609,416.74
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,484,917.46	609,416.74

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	1,984,302.29	-16,315,910.92
——股票投资	1,984,302.29	-16,315,910.92
——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	1,984,302.29	-16,315,910.92

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,186,631.32	401,780.80
基金转换费收入	108,932.59	30,262.32
合计	1,295,563.91	432,043.12

注：A类基金份额：对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其75%计入基金财产；对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有期长于6个月的基金份额所收取的赎回费，其25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

C类基金份额：对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于30日的基金份额所收取的赎回费，不计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	2,400,674.66	1,232,628.20
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,400,674.66	1,232,628.20

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	50,000.00	69,000.00
信息披露费	180,000.00	190,000.00
其他费用	634.00	998.00
合计	230,634.00	259,998.00

注：其他费用为银行手续费。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部和国家税务总局于2016年12月21日和2017年6月30日联合颁布的《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[2016]140号)和《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)的有关规定，自2018年1月1日起，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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(以下简称“长信基金”)	基金管理人、基金销售机构、C类基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司(以下简称“海欣集团”)	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司(以下简称“武汉钢铁”)	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤胜投资”)	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤骏投资”)	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.10 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均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均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均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 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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均没有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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,007,763.97	1,951,545.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,508,028.03	905,848.24

注：支付基金管理人长信基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，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×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	667,960.63	325,257.64
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C	合计
长信基金	-	17.51	17.51
合计	-	17.51	17.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C	合计
合计	-	-	-

注：本基金自2017年7月20日起实行销售服务费分级收费方式：长信量化多策略股票A不收取销售服务费，长信量化多策略股票C的销售服务费按基金前一日基金资产净值×1.00%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：长信量化多策略股票C的日销售服务费=前一日长信量化多策略股票C资产净值×1.00%÷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进行银行间同业市场的债券(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 2017年1月1日至2017年12月31日	
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
基金合同生效日（2015年7月14日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
基金合同生效日（2015年7月14日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,980,576.42	-
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	10,980,576.42	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	28,241,670.99	301,981.97	36,289,468.45	136,740.11

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，于2017年12月31日的相关余额为人民币969,568.84元（2016年12月31日：相关余额为人民币914,876.66元）。

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。本基金非基金中基金，不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017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

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
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.2 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
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大事项	5.81	2018年2月27日	6.00	809,400	4,900,962.38	4,702,614.00	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大事项	10.40	2018年3月22日	9.36	258,200	3,030,017.02	2,685,280.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	股价异动	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	股价异动	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.12.3 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、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，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。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。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

7.4.13.4 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.5 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。

7.4.13.5.1 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。

7.4.13.5.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	28,241,670.99	-	-	-	-	28,241,670.99
结算备付金	969,568.84	-	-	-	-	969,568.84
存出保证金	80,806.10	-	-	-	-	80,806.10
交易性金融资产	-	-	-	-	172,951,723.60	172,951,723.60
应收证券清算款	-	-	-	-	400,638.13	400,638.13
应收利息	-	-	-	-	5,805.01	5,805.01
应收申购款	-	-	-	-	96,040.28	96,040.28
资产总计	29,292,045.93	-	-	-	173,454,207.02	202,746,252.95
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	523,236.06	523,236.06
应付赎回款	-	-	-	-	377,469.41	377,469.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	255,187.84	255,187.84
应付托管费	-	-	-	-	42,531.30	42,531.30
应付销售服务费	-	-	-	-	215.33	215.33
应付交易费用	-	-	-	-	321,694.53	321,694.53
其他负债	-	-	-	-	231,183.02	231,183.02
负债总计	-	-	-	-	1,751,517.49	1,751,517.49
利率敏感度缺口	29,292,045.93	-	-	-	-171,702,689.53	200,994,735.46
上年度末 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	36,289,468.45	-	-	-	-	36,289,468.45
结算备付金	914,876.66	-	-	-	-	914,876.66
存出保证金	42,683.56	-	-	-	-	42,683.56
交易性金融资产	-	-	-	-	177,441,468.82	177,441,468.82
应收利息	-	-	-	-	6,623.68	6,623.68
应收申购款	-	-	-	-	867,963.42	867,963.42
资产总计	37,247,028.67	-	-	-	178,316,055.92	215,563,084.59
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	3,981,124.65	3,981,124.65
应付赎回款	-	-	-	-	1,271,339.80	1,271,339.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	252,784.17	252,784.17
应付托管费	-	-	-	-	42,130.71	42,130.71
应付交易费用	-	-	-	-	342,300.17	342,300.17
其他负债	-	-	-	-	262,612.87	262,612.87
负债总计	-	-	-	-	6,152,292.37	6,152,292.37
利率敏感度缺口	37,247,028.67	-	-	-	-172,163,763.55	209,410,792.22

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。

7.4.13.5.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

7.4.13.5.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.5.3 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：

7.4.13.5.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	172,951,723.60	86.05	177,441,468.82	84.73
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	172,951,723.60	86.05	177,441,468.82	84.73

7.4.13.5.3.2 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（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	VaR值为2.94%（2016年12	-5,910,566.91	-6,198,559.45

	月31日VaR值为2.96%)		
--	-----------------	--	--

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2016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

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币165,415,321.40元，属于第二层次的余额为人民币7,536,402.20元，无属于第三层次的余额（于2016年12月31日：第一层次为人民币175,896,649.34元，第二层次为人民币1,544,819.48元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	172,951,723.60	85.30
	其中：股票	172,951,723.60	85.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,211,239.83	14.41
8	其他各项资产	583,289.52	0.29
9	合计	202,746,252.95	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,974,868.00	1.98
B	采矿业	7,725,634.00	3.84
C	制造业	109,298,941.87	54.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,663,931.20	3.32
E	建筑业	3,588,457.00	1.79
F	批发和零售业	2,435,922.40	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	7,792,820.38	3.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,421,348.55	1.70
J	金融业	18,088,651.00	9.00
K	房地产业	7,880,426.00	3.92
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	2,080,723.20	1.04
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	-	-
	合计	172,951,723.60	86.05

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	67,900	4,751,642.00	2.36
2	000951	中国重汽	271,300	4,728,759.00	2.35
3	600664	哈药股份	809,400	4,702,614.00	2.34
4	000960	锡业股份	269,100	3,552,120.00	1.77
5	600565	迪马股份	802,100	3,208,400.00	1.60
6	603167	渤海轮渡	278,372	3,206,845.44	1.60
7	600036	招商银行	95,200	2,762,704.00	1.37
8	300159	新研股份	258,200	2,685,280.00	1.34
9	600516	方大炭素	89,100	2,573,208.00	1.28
10	000878	云南铜业	174,900	2,481,831.00	1.23
11	300373	扬杰科技	82,500	2,472,525.00	1.23
12	603369	今世缘	157,900	2,449,029.00	1.22
13	002128	露天煤业	216,700	2,401,036.00	1.19
14	600875	东方电气	212,900	2,390,867.00	1.19
15	002146	荣盛发展	250,600	2,388,218.00	1.19
16	600141	兴发集团	141,000	2,382,900.00	1.19
17	000786	北新建材	105,100	2,364,750.00	1.18
18	000338	潍柴动力	281,700	2,349,378.00	1.17
19	600971	恒源煤电	222,300	2,318,589.00	1.15
20	601678	滨化股份	285,000	2,314,200.00	1.15
21	000060	中金岭南	206,400	2,305,488.00	1.15
22	300327	中颖电子	73,700	2,293,544.00	1.14
23	600004	白云机场	155,500	2,285,850.00	1.14
24	600325	华发股份	310,300	2,283,808.00	1.14
25	601919	中远海控	337,100	2,282,167.00	1.14
26	000049	德赛电池	57,300	2,268,507.00	1.13
27	600160	巨化股份	212,400	2,257,812.00	1.12
28	002597	金禾实业	87,000	2,255,040.00	1.12
29	601238	广汽集团	91,200	2,248,992.00	1.12
30	300068	南都电源	139,400	2,241,552.00	1.12

31	002562	兄弟科技	136,000	2,224,960.00	1.11
32	000581	威孚高科	92,000	2,208,000.00	1.10
33	600511	国药股份	79,400	2,207,320.00	1.10
34	600958	东方证券	159,200	2,206,512.00	1.10
35	600166	福田汽车	778,900	2,188,709.00	1.09
36	000988	华工科技	132,000	2,188,560.00	1.09
37	000822	山东海化	241,400	2,184,670.00	1.09
38	000661	长春高新	11,800	2,159,400.00	1.07
39	600449	宁夏建材	189,400	2,147,796.00	1.07
40	600782	新钢股份	325,300	2,140,474.00	1.06
41	002449	国星光电	123,300	2,135,556.00	1.06
42	600409	三友化工	222,600	2,134,734.00	1.06
43	002185	华天科技	249,800	2,128,296.00	1.06
44	002477	雏鹰农牧	475,700	2,112,108.00	1.05
45	000598	兴蓉环境	387,400	2,103,582.00	1.05
46	600720	祁连山	201,900	2,089,665.00	1.04
47	600893	航发动力	77,500	2,085,525.00	1.04
48	300034	钢研高纳	166,630	2,054,547.90	1.02
49	002396	星网锐捷	95,000	2,051,050.00	1.02
50	300422	博世科	120,000	2,048,400.00	1.02
51	002068	黑猫股份	205,500	1,991,295.00	0.99
52	600030	中信证券	107,800	1,951,180.00	0.97
53	002234	民和股份	163,400	1,862,760.00	0.93
54	601666	平煤股份	268,200	1,689,660.00	0.84
55	601166	兴业银行	96,300	1,636,137.00	0.81
56	002407	多氟多	78,500	1,602,970.00	0.80
57	000050	深天马A	81,300	1,602,423.00	0.80
58	600569	安阳钢铁	340,900	1,602,230.00	0.80
59	000100	TCL集	410,700	1,601,730.00	0.80
60	601211	国泰君安	85,100	1,576,052.00	0.78
61	000513	丽珠集团	23,700	1,574,865.00	0.78
62	600570	恒生电子	33,800	1,568,320.00	0.78
63	600837	海通证券	120,800	1,554,696.00	0.77
64	600879	航天电子	196,500	1,540,560.00	0.77
65	000498	山东路桥	227,400	1,519,032.00	0.76
66	300050	世纪鼎利	189,200	1,489,004.00	0.74
67	300088	长信科技	180,100	1,410,183.00	0.70
68	300335	迪森股份	77,700	1,356,642.00	0.67
69	600502	安徽水利	184,100	1,268,449.00	0.63

70	300232	洲明科技	81,700	1,168,310.00	0.58
71	002626	金达威	61,200	1,145,664.00	0.57
72	000157	中联重科	210,500	940,935.00	0.47
73	600104	上汽集团	27,400	877,896.00	0.44
74	000669	金鸿控股	58,000	849,700.00	0.42
75	601717	郑煤机	127,400	838,292.00	0.42
76	601601	中国太保	20,100	832,542.00	0.41
77	000825	太钢不锈	167,500	830,800.00	0.41
78	002334	英威腾	97,100	825,350.00	0.41
79	600016	民生银行	97,400	817,186.00	0.41
80	600900	长江电力	52,200	813,798.00	0.40
81	002155	湖南黄金	82,800	803,160.00	0.40
82	601668	中国建筑	88,800	800,976.00	0.40
83	002233	塔牌集团	65,400	778,914.00	0.39
84	600674	川投能源	75,300	766,554.00	0.38
85	600856	中天能源	64,800	757,512.00	0.38
86	002385	大北农	120,100	727,806.00	0.36
87	002223	鱼跃医疗	34,800	682,080.00	0.34
88	601766	中国中车	54,700	662,417.00	0.33
89	600395	盘江股份	74,700	513,189.00	0.26
90	000400	许继电气	38,900	513,091.00	0.26
91	000997	新大陆	18,400	329,912.00	0.16
92	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.13
93	601877	正泰电器	9,600	251,040.00	0.12
94	600859	王府井	11,206	228,602.40	0.11
95	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.09
96	300735	N光弘	2,823	40,622.97	0.02
97	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
98	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
99	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
100	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
101	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
102	002922	N伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
103	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
104	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
105	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
106	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
107	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
108	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01

109	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

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	000951	中国重汽	9,556,552.37	4.56
2	000039	中集集团	9,298,706.79	4.44
3	002532	新界泵业	9,191,002.89	4.39
4	300250	初灵信息	7,803,787.00	3.73
5	300292	吴通控股	7,431,120.00	3.55
6	000036	华联控股	7,341,792.28	3.51
7	600782	新钢股份	6,874,179.00	3.28
8	002152	广电运通	6,816,171.40	3.25
9	002172	澳洋科技	6,715,848.50	3.21
10	600325	华发股份	6,177,857.10	2.95
11	002354	天神娱乐	6,151,443.00	2.94
12	600502	安徽水利	6,065,749.93	2.90
13	000957	中通客车	6,001,520.00	2.87
14	300351	永贵电器	5,988,977.49	2.86
15	600507	方大特钢	5,778,626.00	2.76
16	600697	欧亚集团	5,764,418.65	2.75
17	600983	惠而浦	5,724,564.32	2.73
18	601318	中国平安	5,650,902.00	2.70
19	603167	渤海轮渡	5,647,465.48	2.70
20	600997	开滦股份	5,630,616.00	2.69
21	601007	金陵饭店	5,624,645.68	2.69
22	600894	广日股份	5,595,645.51	2.67
23	002477	雏鹰农牧	5,548,486.00	2.65
24	300242	明家联合	5,521,673.96	2.64
25	300295	三六五网	5,499,521.20	2.63
26	002682	龙洲股份	5,487,803.49	2.62
27	300234	开尔新材	5,441,756.00	2.60
28	002329	皇氏集团	5,430,151.00	2.59
29	300043	星辉娱乐	5,377,171.62	2.57

30	600683	京投发展	5,352,051.00	2.56
31	600114	东睦股份	5,350,374.24	2.55
32	002165	红宝丽	5,309,759.00	2.54
33	300371	汇中股份	5,293,852.48	2.53
34	000404	华意压缩	5,270,728.17	2.52
35	600664	哈药股份	5,238,229.00	2.50
36	002026	山东威达	5,230,372.00	2.50
37	600971	恒源煤电	5,218,507.00	2.49
38	300160	秀强股份	5,199,471.00	2.48
39	002215	诺普信	5,190,385.00	2.48
40	600183	生益科技	5,188,729.20	2.48
41	300375	鹏翎股份	5,174,815.40	2.47
42	601231	环旭电子	5,172,717.00	2.47
43	600565	迪马股份	5,167,376.00	2.47
44	002376	新北洋	5,163,803.00	2.47
45	000960	锡业股份	5,161,853.09	2.46
46	002662	京威股份	5,156,128.00	2.46
47	600743	华远地产	5,145,458.00	2.46
48	600889	南京化纤	5,085,395.00	2.43
49	002156	通富微电	5,062,518.00	2.42
50	002106	莱宝高科	5,049,943.00	2.41
51	002094	青岛金王	5,042,740.00	2.41
52	002501	利源精制	4,995,900.00	2.39
53	000530	大冷股份	4,973,547.00	2.38
54	002357	富临运业	4,954,427.00	2.37
55	600761	安徽合力	4,953,491.00	2.37
56	002133	广宇集团	4,948,746.00	2.36
57	000528	柳工	4,945,216.26	2.36
58	600240	华业资本	4,936,380.00	2.36
59	300047	天源迪科	4,909,181.85	2.34
60	300218	安利股份	4,900,196.59	2.34
61	300332	天壕环境	4,878,396.00	2.33
62	000550	江铃汽车	4,845,630.41	2.31
63	601126	四方股份	4,810,387.00	2.30
64	601877	正泰电器	4,795,701.62	2.29
65	300241	瑞丰光电	4,771,918.76	2.28

66	002182	云海金属	4,759,960.57	2.27
67	600783	鲁信创投	4,704,701.18	2.25
68	300106	西部牧业	4,693,791.40	2.24
69	002636	金安国纪	4,660,405.00	2.23
70	000498	山东路桥	4,654,593.00	2.22
71	002013	中航机电	4,647,656.75	2.22
72	002546	新联电子	4,628,191.00	2.21
73	002541	鸿路钢构	4,614,686.52	2.20
74	300303	聚飞光电	4,577,372.25	2.19
75	000708	大冶特钢	4,562,272.35	2.18
76	300159	新研股份	4,505,126.00	2.15
77	300025	华星创业	4,501,451.00	2.15
78	600057	象屿股份	4,499,879.00	2.15
79	002398	建研集团	4,493,517.00	2.15
80	002307	北新路桥	4,482,528.00	2.14
81	002234	民和股份	4,431,134.00	2.12
82	002588	史丹利	4,385,331.22	2.09
83	002637	赞宇科技	4,357,462.00	2.08
84	002110	三钢闽光	4,319,700.00	2.06
85	600883	博闻科技	4,291,512.30	2.05
86	300262	巴安水务	4,285,113.39	2.05
87	002296	辉煌科技	4,260,848.37	2.03
88	002540	亚太科技	4,232,278.50	2.02
89	002344	海宁皮城	4,231,613.00	2.02

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	000039	中集集团	10,048,265.39	4.80
2	600507	方大特钢	9,959,477.00	4.76
3	000036	华联控股	9,201,040.34	4.39
4	002532	新界泵业	9,101,658.72	4.35
5	300292	吴通控股	7,270,817.00	3.47

6	300106	西部牧业	7,001,241.70	3.34
7	600282	南钢股份	6,840,112.00	3.27
8	002172	澳洋科技	6,625,525.50	3.16
9	002156	通富微电	6,307,957.50	3.01
10	600183	生益科技	6,293,083.54	3.01
11	002152	广电运通	6,234,631.18	2.98
12	002354	天神娱乐	6,114,072.15	2.92
13	002182	云海金属	6,098,909.00	2.91
14	002682	龙洲股份	6,089,439.30	2.91
15	601231	环旭电子	5,933,692.00	2.83
16	600782	新钢股份	5,852,312.40	2.79
17	002307	北新路桥	5,794,712.00	2.77
18	000957	中通客车	5,766,942.00	2.75
19	002636	金安国纪	5,732,208.00	2.74
20	601313	江南嘉捷	5,697,880.92	2.72
21	300250	初灵信息	5,695,578.20	2.72
22	002215	诺普信	5,599,863.00	2.67
23	600983	惠而浦	5,597,256.31	2.67
24	002094	青岛金王	5,588,389.99	2.67
25	000951	中国重汽	5,532,925.00	2.64
26	300295	三五五网	5,511,575.80	2.63
27	002026	山东威达	5,472,770.00	2.61
28	600114	东睦股份	5,396,836.52	2.58
29	002106	莱宝高科	5,380,047.00	2.57
30	000404	华意压缩	5,337,784.25	2.55
31	300371	汇中股份	5,243,983.04	2.50
32	600533	栖霞建设	5,208,979.00	2.49
33	002662	京威股份	5,149,137.00	2.46
34	600761	安徽合力	5,140,692.02	2.45
35	600240	华业资本	5,127,934.15	2.45
36	300160	秀强股份	5,112,827.00	2.44
37	600502	安徽水利	5,090,308.67	2.43
38	002329	皇氏集团	5,070,139.00	2.42
39	300241	瑞丰光电	4,994,993.23	2.39
40	601877	正泰电器	4,988,166.06	2.38
41	300043	星辉娱乐	4,959,179.00	2.37
42	300351	永贵电器	4,901,193.22	2.34
43	600997	开滦股份	4,878,122.00	2.33

44	600697	欧亚集团	4,870,622.69	2.33
45	601126	四方股份	4,860,805.90	2.32
46	002398	建研集团	4,792,394.00	2.29
47	600889	南京化纤	4,721,738.00	2.25
48	600743	华远地产	4,665,709.60	2.23
49	600783	鲁信创投	4,655,281.27	2.22
50	002376	新北洋	4,628,843.48	2.21
51	300151	昌红科技	4,597,178.41	2.20
52	600894	广日股份	4,586,516.94	2.19
53	002013	中航机电	4,571,846.92	2.18
54	300262	巴安水务	4,547,348.47	2.17
55	002501	利源精制	4,543,589.95	2.17
56	300375	鹏翎股份	4,508,723.73	2.15
57	000528	柳工	4,484,637.00	2.14
58	002296	辉煌科技	4,483,748.10	2.14
59	002546	新联电子	4,477,336.00	2.14
60	601636	旗滨集团	4,476,736.50	2.14
61	002165	红宝丽	4,435,264.00	2.12
62	002504	*ST弘	4,383,238.50	2.09
63	002483	润邦股份	4,354,569.56	2.08
64	002110	三钢闽光	4,347,503.99	2.08
65	300242	明家联合	4,326,336.28	2.07
66	000550	江铃汽车	4,304,110.32	2.06
67	300121	阳谷华泰	4,296,689.00	2.05
68	300025	华星创业	4,275,998.95	2.04
69	002541	鸿路钢构	4,266,349.97	2.04
70	600883	博闻科技	4,261,283.52	2.03
71	000789	万年青	4,247,492.00	2.03
72	601007	金陵饭店	4,242,398.00	2.03
73	300047	天源迪科	4,242,256.80	2.03
74	600131	岷江水电	4,221,975.40	2.02
75	000708	大冶特钢	4,219,392.22	2.01
76	603663	三祥新材	4,201,611.98	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	990,036,226.37
卖出股票收入（成交）总额	989,024,442.00

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。

8.8 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	80,806.10
2	应收证券清算款	400,638.13
3	应收股利	-
4	应收利息	5,805.01
5	应收申购款	96,040.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	583,289.52

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600664	哈药股份	4,702,614.00	2.34	重大资产重组
2	300159	新研股份	2,685,280.00	1.34	重大资产重组

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信量化多策略股票A	6,167	26,094.10	57,993,161.09	36.04%	102,929,169.93	63.96%
长信量化多策略股票C	10	21,164.28	0.00	0.00%	211,642.78	100.00%
合计	6,177	26,086.12	57,993,161.09	35.99%	103,140,812.71	64.01%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信量化多策略股票A	1,099,649.55	0.68%
	长信量化多策略股票C	0.00	0.00%
	合计	1,099,649.55	0.68%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长信量化多策略股票A	50~100
	长信量化多策略股票C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	长信量化多策略股票A	50~100
	长信量化多策略股票C	0
	合计	50~100

§ 10开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信量化多策略股票A	长信量化多策略股票C
基金合同生效日（2015年7月14日）基金份额总额	648,523,672.21	-
本报告期期初基金份额总额	164,987,040.12	-
本报告期基金总申购份额	291,579,746.70	239,503.08
减:本报告期基金总赎回份额	295,644,455.80	27,860.30
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	160,922,331.02	211,642.78

注：基金管理人决定自2017年7月20日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额，具体事宜可详见基金管理人于2017年7月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》。

§ 11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金非基金中基金，报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金更换了会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币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1年。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易	应支付该券商的佣金

		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	3	1,375,577,992.55	69.75%	919,653.89	74.37%	-
安信证券	2	596,678,932.34	30.25%	317,018.35	25.63%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	97,628.97	0.97%	30,000,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	9,999,990.00	99.03%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购、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、公司网站	2017年1月12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、公司网站	2017年1月13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、公司网站	2017年1月14日
4	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、公司网站	2017年1月17日
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月17日
6	长信量化多策略股票型证券投资基金2016年第4季度报告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月21日
7	长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月8日
8	长信基金管理有限责任公司关于增加国都证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年2月22日
9	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、公司网站	2017年2月23日
10	长信量化多策略股票型证券投资基金更新的招募说明书（2017年【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月27日
11	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宜信普泽投资顾问（北京）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、公司网站	2017年3月10日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月22日
13	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、公司网站	2017年3月22日
14	长信量化多策略股票型证券投资基金2016年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月27日
15	长信基金管理有限责任公司关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下长信量	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月27日

	化多策略股票型证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
16	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工商银行股份有限公司个人电子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、公司网站	2017年3月30日
17	长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通过直销中心认购、申购旗下部分基金费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月30日
18	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、公司网站	2017年4月1日
19	长信量化多策略股票型证券投资基金2017年第1季度报告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年4月22日
20	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、公司网站	2017年4月22日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加财通证券股份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、公司网站	2017年4月25日
22	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平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、公司网站	2017年5月4日
23	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、公司网站	2017年5月12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、公司网站	2017年5月24日
25	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泰证券股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月26日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加中国农业银行股份有限公司为旗下长信量化多策略股票型证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年6月9日
27	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、公司网站	2017年6月30日
28	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基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月1日
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月5日
30	长信基金管理有限责任公司关于设立武汉分公司的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月8日

31	长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月17日
32	长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同（增加C份额后更新的合同）	公司网站	2017年7月17日
33	长信量化多策略股票型证券投资基金托管协议（增加C份额后更新的托管协议）	公司网站	2017年7月17日
34	长信基金管理有限责任公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下长信量化多策略股票型证券投资基金（C类份额）代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月18日
35	长信量化多策略股票型证券投资基金2017年第2季度报告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月19日
36	长信基金管理有限责任公司关于修改长信量化多策略股票型证券投资基金在上海证券交易所场内简称的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月19日
37	长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金C类基金份额净值计算与披露方法的说明	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月20日
38	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华泰证券股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月28日
39	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上海华夏财富投资管理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、证券日报、公司网站	2017年8月14日
40	长信基金管理有限责任公司关于增加一路财富（北京）信息科技股份有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年8月15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、公司网站	2017年8月18日
42	长信量化多策略股票型证券投资基金2017年半年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年8月24日
43	长信量化多策略股票型证券投资基金更新的招募说明书（2017年第【2】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年8月26日
44	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泰证券股份有限公司申购（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、公司网站	2017年9月5日
45	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、公司网站	2017年9月8日
46	长信基金管理有限责任公司关于增加和谐保险销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年10月13日
47	长信量化多策略股票型证券投资基金2017年第3季度报告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年10月27日
48	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年11月11日

49	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年11月17日
50	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月18日
51	长信基金管理有限责任公司关于改聘会计师事务所公告（德勤）	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月19日
52	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、公司网站	2017年12月28日
53	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农业银行股份有限公司基金及基金组合申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月28日
54	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月28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、公司网站	2017年12月29日
56	长信基金管理有限责任公司关于资管产品增值税事项的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月30日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年11月3日至2017年12月31日	0.00	37,993,161.09	0.00	37,993,161.09	23.58%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§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、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化多策略股票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

2018年3月31日