

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型 证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信标普 100 等权重指数 (QDII)
场内简称	长信标普 100
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 30 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,035,414.29 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔 100 等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普 100 等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于 80% 的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔 100 等权重指数总收益率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王永民
	联系电话	021-61009999	010-66594896
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4007005566	95566
传真		021-61009800	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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 1 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	3,215,572.60	-378,414.24	183,437.20
本期利润	2,382,349.92	2,609,539.72	486,973.74
加权平均基金份额本期利润	0.0446	0.1279	0.0229
本期基金份额净值增长率	8.32%	13.18%	2.33%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0848	0.0154	0.0346
期末基金资产净值	40,860,940.71	40,864,063.23	19,065,280.92
期末基金份额净值	1.237	1.142	1.009

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。

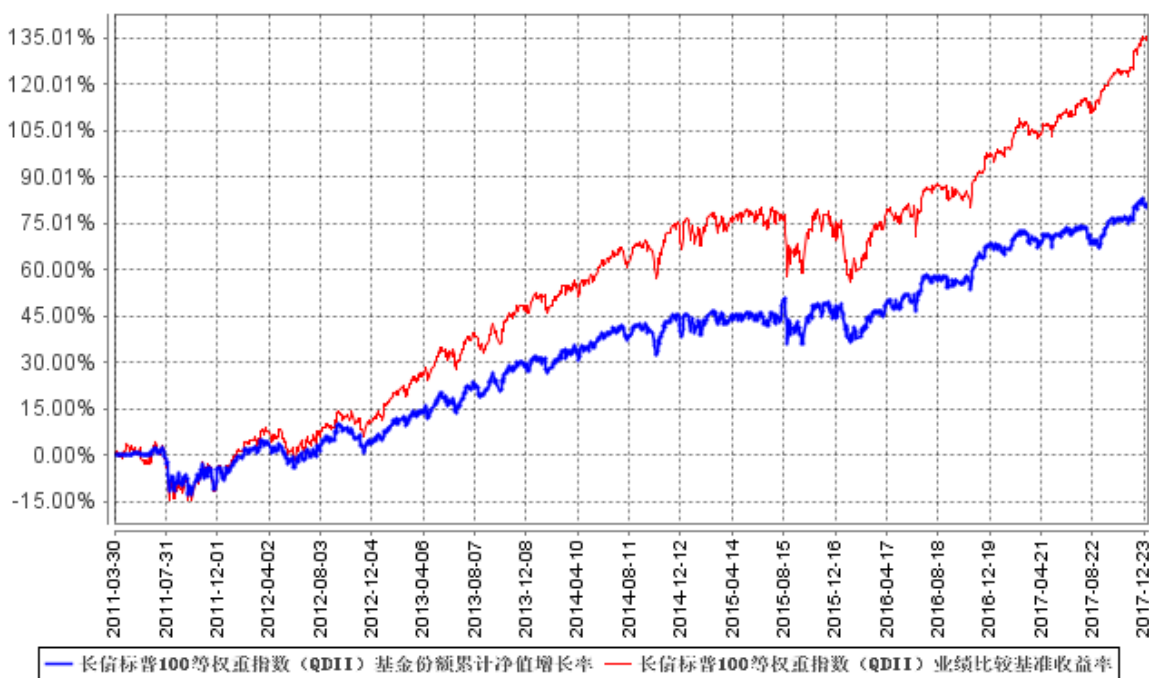
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.83%	0.39%	6.26%	0.35%	-3.43%	0.04%
过去六个月	5.10%	0.42%	11.44%	0.39%	-6.34%	0.03%
过去一年	8.32%	0.43%	20.17%	0.41%	-11.85%	0.02%
过去三年	25.46%	0.71%	34.50%	0.82%	-9.04%	-0.11%
过去五年	70.41%	0.74%	107.49%	0.78%	-37.08%	-0.04%
自基金合同生效起至今	80.23%	0.83%	133.00%	0.93%	-52.77%	-0.10%

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

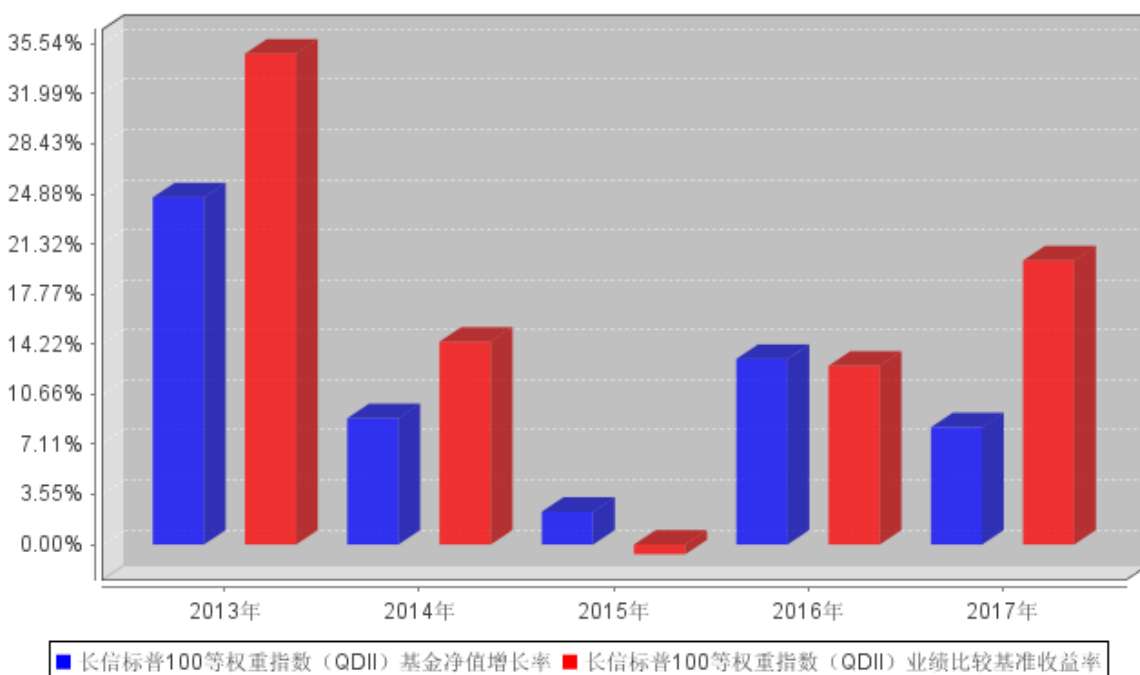


注：1、图示日期为 2011 年 3 月 30 日至 2017 年 12 月 31 日。

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

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年没有进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 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		
杨帆	长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理、国际业务部副总监	2017 年 4 月 20 日	-	11 年	工商管理学硕士，北京大学工商管理学硕士毕业，曾在莫尼塔投资发展有限公司担任研究员、敦和资产管理有限公司担任高级研究员，2017 年 3 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部副总监、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。
傅瑶纯	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理助理	2017 年 5 月 9 日	-	2 年	金融学硕士，毕业于英国华威大学，具有基金从业资格。曾任职于中国农业银行上海市分行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理助理。

薛天	曾任本基金的基金经理	2011 年 3 月 30 日	2017 年 6 月 28 日	20 年	曾任本基金的基金经理
----	------------	--------------------	--------------------	------	------------

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

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

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

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

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

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

4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾整个 2017 年，标普 500 全年累计涨幅达到 19.42%。分时间段而言，一季度美国经济活动表现不好主要受到暴风雪的影响，GDP 增速环比下降 0.6 个百分点，不过受到油价回升影响，1 季度企业投资增长加速 7.2%；进入 2 季度后，季节干扰因素消失，加上企业投资维持稳健成长，美国 GDP 增长率加速至 3.1%；进入到下半年后，企业库存增加叠加贸易逆差缩小抵消了飓风的不良影响，使得美国 GDP 在三季度仍然维持 3% 以上的高成长。尽管面对高基数，不过在消费维持强劲，企业投资持续稳健，以及风灾后房市重建需求的带动下，四季度 GDP 增长 2.6%，去年

全年增速为 2.3%

另一方面，美国的税改法案最终在 2017 年年底通过，确定将于 2018 年正式实施。据测算，税改实施后，整体 S&P500 企业的有效税率为 28%，降低企业税率至 21%将有效提振企业整体的获利能力，而居民税率的降低也将提升投资比例，预计两者叠加提升 GDP 成长可以达到 0.5%以上。

本基金跟踪的指数去年全年累计涨幅达到了 20.17%，但由于去年下半年开始人民币表现强势，本基金未对美元敞口做对冲操作，受到币种拖累原因，表现逊色于指数走势；另一方面，由于年初本基金受到严重现金拖累原因，导致指数在上涨过程中未能享受到部分收益，除去这两部分原因，基金增长率与指数走势基本吻合，跟踪误差控制在一定范围内。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.237 元，份额累计净值为 1.633 元，本报告期内本基金净值增长率为 8.32%，同期业绩比较基准涨幅为 20.17%。同期人民币升值 5.81%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 2016 年初开始全球主要经济体均出现了共振式的复苏，至今持续 2 年左右的时间。本轮经济上行周期背后的推动力包括中国的地产放松政策，美国减税政策带来的企业投资支出上升，欧洲前期的量化宽松和汇率贬值对本地经济的刺激，以及各经济体前后进入库存上行周期的共振效应所致。到目前为止，除美国减税外，其他几个刺激因素的正面贡献力量预计将逐渐有所消退，我们预计美国和中国名义 GDP 增速在 2018 年将难以继续加速，并有可能出现一定幅度的放缓。

目前标普指数的估值水平大致处于历史 90%-95%的分位处，是历史上很高的水平。指数成分股估值普遍处于历史高位，同时大量被动型基金的集中持仓问题也带来市场波动率可能大幅上升的风险。我们对于 2018 年标普指数持中性略偏谨慎的看法，我们认为标普指数将高位大幅震荡。

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及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

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 6、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额净值分配金额后不能低于面值；
- 7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.9 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

自 2014 年 8 月 13 日至 2014 年 11 月 7 日, 本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万元, 本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。自 2017 年 2 月 27 日起至 2017 年 7 月 17 日, 本基金资产净值高于五千万元。自 2017 年 7 月 18 日至 2017 年 8 月 14 日, 本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。自 2017 年 9 月 28 日起至 2017 年 10 月 10 日, 本基金资产净值高于五千万元。自 2017 年 10 月 11 日至 2017 年 11 月 7 日, 本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。截至报告期末, 本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）对长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告期末基金 2017 年度财务报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（安永华明(2018)审字第 61399737_B06 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：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,172,109.59	12,641,946.23
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	37,155,138.86	28,337,630.46
其中：股票投资	37,155,138.86	28,337,630.46
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	860.01	2,332.74
应收股利	33,382.37	25,147.32
应收申购款	172,436.32	1,031,733.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	41,533,927.15	42,038,789.81
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	205,563.44	493,582.73
应付管理人报酬	37,649.58	31,882.26
应付托管费	10,268.05	8,695.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	419,505.37	640,566.41
负债合计	672,986.44	1,174,726.58
所有者权益:		
实收基金	33,035,414.29	35,780,561.15
未分配利润	7,825,526.42	5,083,502.08
所有者权益合计	40,860,940.71	40,864,063.23
负债和所有者权益总计	41,533,927.15	42,038,789.81

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.237 元，基金份额总额 33,035,414.29 份。

7.2 利润表

公告主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本 期	上 年 度 可 比 期 间
-----	-----	---------------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	3,713,184.54	3,277,398.28
1. 利息收入	42,761.89	15,005.55
其中：存款利息收入	42,761.89	15,005.55
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,681,175.81	161,658.52
其中：股票投资收益	3,554,377.41	-212,004.11
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	1,126,798.40	373,662.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-833,222.68	2,987,953.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-346,097.29	104,423.85
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	168,566.81	8,356.40
减：二、费用	1,330,834.62	667,858.56
1. 管理人报酬	691,389.24	234,722.98
2. 托管费	188,560.75	64,015.35
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	58,433.01	3,884.25

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	392,451.62	365,235.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,382,349.92	2,609,539.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,382,349.92	2,609,539.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：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）	35,780,561.15	5,083,502.08	40,864,063.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,382,349.92	2,382,349.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,745,146.86	359,674.42	-2,385,472.44
其中：1. 基金申购款	113,690,370.33	20,258,237.27	133,948,607.60
2. 基金赎回款	-116,435,517.19	-19,898,562.85	-136,334,080.04
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)	33,035,414.29	7,825,526.42	40,860,940.71
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)	18,898,724.43	166,556.49	19,065,280.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	2,609,539.72	2,609,539.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	16,881,836.72	2,307,405.87	19,189,242.59
其中: 1. 基金申购款	24,611,032.40	2,772,040.67	27,383,073.07
2. 基金赎回款	-7,729,195.68	-464,634.80	-8,193,830.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	35,780,561.15	5,083,502.08	40,864,063.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2010〕1586 号文《关于核准长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 3 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 508,424,713.40 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和证监会允许本基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于

在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府

债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未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(以下简称“长信基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司(以下简称“中银香港”)	基金境外托管人
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。

7.4.8 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

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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 基金交易

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基金交易。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	691,389.24	234,722.98
其中：支付销售机构的客户维护费	202,571.84	51,443.41

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值

1.1%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.1%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	188,560.75	64,015.35

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.3%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (-	-

2011 年 3 月 30 日) 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,888.88	10,001,888.88
期末持有的基金份额占基金总份额比例	30.28%	27.95%

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。

7.4.8.4.2 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 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
	中国银行	4,045,347.81	40,846.10	12,472,994.35
中银香港	126,761.78	-	168,951.55	-

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注: 上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行, 并以一般交易价格为定价基础。本基金非基金中基金, 不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

7.4.9 期末 (2017 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: 本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 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	37,155,138.86	89.46
	其中：普通股	37,155,138.86	89.46
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,172,109.59	10.04
8	其他各项资产	206,678.70	0.50
9	合计	41,533,927.15	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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币

元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	37,155,138.86	90.93
合计	37,155,138.86	90.93

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
保健	4,871,707.73	11.92
必需消费品	4,303,671.51	10.53
材料	664,299.71	1.63
电信服务	996,354.29	2.44
非必需消费品	4,666,471.54	11.42
工业	4,918,817.88	12.04
公共事业	1,867,765.38	4.57
金融	6,196,292.98	15.16
能源	2,816,081.22	6.89
信息技术	5,853,676.62	14.33
合计	37,155,138.86	90.93

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	FACEBOOK INC-A	Facebook 公司	FB US	纳斯达克	美国	695	122,639.70	1.96
2	PCLN US	Priceline 集团	PCLN US	纳斯达克	美国	70	121,641.80	1.95
3	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽交所	美国	6,693	120,942.51	1.93
4	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏	KHC US	纳斯达克	美国	1,514	117,728.64	1.88
5	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克	美国	1,114	116,257.04	1.86
6	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽交所	美国	9,333	116,569.17	1.86

7	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纽交所	美国	2,918	114,998.38	1.84
8	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	2,428	112,076.48	1.79
9	BLK US	贝莱德有限公司	BLK US	纽交所	美国	209	107,365.39	1.72
10	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	纽交所	美国	1,143	106,093.26	1.70

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。

8.4.1 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	KINDER MORGAN INC	KMI US	1,829,694.62	4.48
2	CELGENE CORP	CELG US	1,490,395.22	3.65
3	The Priceline Group	PCLN US	1,464,465.65	3.58
4	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	1,406,620.87	3.44
5	Facebook Inc	FB US	1,404,594.69	3.44
6	MORGAN STANLEY	MS US	1,401,423.15	3.43
7	US BANCORP	USB US	1,372,886.47	3.36
8	HALLIBURTON CO	HAL US	1,360,564.74	3.33
9	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	1,293,293.96	3.17
10	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	1,268,903.01	3.11
11	CHEVRON CORP	CVX US	1,254,405.84	3.07
12	DANAHER CORP	DHR US	1,244,291.25	3.05
13	CONOCOPHILLIPS	COP US	1,242,887.02	3.04
14	EXELON CORP	EXC US	1,240,839.73	3.04
15	FORD MOTOR CO	F US	1,239,674.81	3.03
16	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,200,132.43	2.94
17	INTEL CORP	INTC US	1,190,908.24	2.91
18	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	1,160,586.73	2.84
19	BLK US	BLK US	1,149,624.49	2.81

20	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,111,883.08	2.72
21	APPLE INC	AAPL US	1,093,811.99	2.68
22	CITIGROUP INC	C US	1,084,804.00	2.65
23	TIME WARNER INC	TWX US	1,068,882.79	2.62
24	BOEING CO/THE	BA US	1,060,601.74	2.60
25	GENERAL DYNAMICS CORP	GD US	1,046,075.66	2.56
26	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	1,013,135.43	2.48
27	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	1,005,804.21	2.46
28	METLIFE INC	MET US	997,395.22	2.44
29	GENERAL MOTORS CO	GM US	994,459.13	2.43
30	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	991,992.51	2.43
31	MICROSOFT CORP	MSFT US	988,732.55	2.42
32	CATERPILLAR INC	CAT US	968,429.89	2.37
33	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	952,842.28	2.33
34	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	950,621.08	2.33
35	WELLS FARGO & CO	WFC US	950,558.01	2.33
36	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	944,230.50	2.31
37	ALLSTATE CORP	ALL US	942,104.11	2.31
38	MERCK & CO. INC.	MRK US	938,008.95	2.30
39	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	937,954.53	2.30
40	ALTRIA GROUP INC	MO US	935,204.27	2.29
41	UNION PACIFIC CORP	UNP US	934,685.12	2.29
42	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	933,584.49	2.28
43	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	932,149.24	2.28
44	FEDEX CORP	FDX US	929,453.29	2.27
45	DOW CHEMICAL CO/THE	DOW US	929,293.57	2.27
46	AMAZON.COM INC	AMZN US	927,002.37	2.27
47	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	DD US	925,976.91	2.27
48	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	919,165.16	2.25
49	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	915,653.08	2.24
50	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	914,093.69	2.24
51	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	912,902.82	2.23
52	MASTERCARD INC-CLASS A	MA US	912,772.31	2.23
53	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BK US	911,719.65	2.23
54	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	909,635.29	2.23
55	BIOGEN INC	BIIB US	901,322.28	2.21
56	AGN US	AGN US	890,436.03	2.18
57	HOME DEPOT INC	HD US	887,836.97	2.17
58	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	887,754.55	2.17
59	ORACLE CORP	ORCL US	887,318.52	2.17
60	QUALCOMM INC	QCOM US	883,610.87	2.16
61	RAYTHEON COMPANY	RTN US	881,352.28	2.16
62	ELI LILLY & CO	LLY US	880,099.03	2.15

63	3M CO	MMM US	877,124.44	2.15
64	UNITED TECHNOLOGIES CORP	UTX US	877,001.64	2.15
65	AMGEN INC	AMGN US	876,305.59	2.14
66	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	870,818.39	2.13
67	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	870,518.70	2.13
68	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	870,046.09	2.13
69	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	866,545.29	2.12
70	AT&T INC	T US	864,322.96	2.12
71	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	864,074.91	2.11
72	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	853,798.19	2.09
73	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	852,441.41	2.09
74	NIKE INC -CL B	NKE US	847,159.77	2.07
75	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	841,986.87	2.06
76	STARBUCKS CORP	SBUX US	836,834.36	2.05
77	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	834,996.73	2.04
78	PEPSICO INC	PEP US	829,938.61	2.03
79	LOWES COS INC	LOW US	828,074.11	2.03
80	ABBVIE INC-WHEN ISSUED	ABBV US	826,856.72	2.02
81	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UPS US	817,764.98	2.00
82	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	817,729.71	2.00
83	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	MCD US	815,539.00	2.00

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	MORGAN STANLEY	MS US	1,531,808.07	3.75
2	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	1,522,301.19	3.73
3	BOEING CO/THE	BA US	1,344,787.97	3.29
4	DOWDUPONT INC Equity	DWDP US	1,304,195.06	3.19
5	CONOCOPHILLIPS	COP US	1,274,278.77	3.12
6	APPLE INC	AAPL US	1,264,163.73	3.09
7	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	1,254,575.87	3.07
8	CHEVRON CORP	CVX US	1,252,353.65	3.06
9	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,245,696.03	3.05
10	CITIGROUP INC	C US	1,229,991.73	3.01
11	CATERPILLAR INC	CAT US	1,204,254.20	2.95
12	HALLIBURTON CO	HAL US	1,174,033.98	2.87

13	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,158,685.69	2.84
14	KINDER MORGAN INC	KMI US	1,152,995.48	2.82
15	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,126,745.28	2.76
16	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,121,447.16	2.74
17	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	1,106,749.93	2.71
18	GENERAL DYNAMICS CORP	GD US	1,106,558.47	2.71
19	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,097,778.91	2.69
20	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	1,088,411.27	2.66
21	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	1,059,265.57	2.59
22	TIME WARNER INC	TWX US	1,054,361.91	2.58
23	ALLSTATE CORP	ALL US	1,051,769.59	2.57
24	MASTERCARD INC-CLASS A	MA US	1,050,727.60	2.57
25	Facebook Inc	FB US	1,034,388.31	2.53
26	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	1,027,499.25	2.51
27	PCLN US	PCLN US	1,020,297.47	2.50
28	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	1,014,638.10	2.48
29	FEDEX CORP	FDX US	1,007,695.44	2.47
30	UNION PACIFIC CORP	UNP US	989,567.51	2.42
31	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	969,476.70	2.37
32	GENERAL MOTORS CO	GM US	968,399.94	2.37
33	MCDONALDS CORP	MCD US	962,682.42	2.36
34	3M CO	MMM US	959,972.00	2.35
35	METLIFE INC	MET US	958,360.08	2.35
36	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	957,559.55	2.34
37	HOME DEPOT INC	HD US	955,818.93	2.34
38	ABBVIE INC-WHEN ISSUED	ABBV US	952,737.43	2.33
39	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	949,286.70	2.32
40	US BANCORP	USB US	945,118.69	2.31
41	RAYTHEON COMPANY	RTN US	940,192.99	2.30
42	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	937,410.56	2.29
43	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	933,843.29	2.29
44	CELGENE CORP	CELG US	932,363.47	2.28
45	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BK US	929,712.42	2.28
46	ORACLE CORP	ORCL US	916,762.53	2.24
47	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	905,107.22	2.22
48	UNITED TECHNOLOGIES CORP	UTX US	901,274.44	2.21
49	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	888,005.62	2.17
50	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	883,808.45	2.16
51	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	877,942.05	2.15
52	WELLS FARGO & CO	WFC US	876,568.87	2.15
53	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	DD US	876,055.67	2.14
54	WAL-MART STORES INC	WMT US	873,467.48	2.14
55	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	867,651.63	2.12

56	ALTRIA GROUP INC	MO US	857,462.97	2.10
57	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	856,068.00	2.10
58	BLK US	BLK US	853,591.96	2.09
59	BIOGEN INC	BIIB US	848,494.36	2.08
60	QUALCOMM INC	QCOM US	847,078.67	2.07
61	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	844,906.08	2.07
62	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	842,316.03	2.06
63	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	838,040.71	2.05
64	MERCK & CO. INC.	MRK US	832,396.25	2.04
65	STARBUCKS CORP	SBUX US	831,509.38	2.03
66	ELI LILLY & CO	LLY US	824,352.63	2.02
67	PEPSICO INC	PEP US	819,562.52	2.01
68	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	819,438.01	2.01
69	DANAHER CORP	DHR US	818,347.50	2.00
70	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	816,158.01	2.00

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	97,808,123.92
卖出收入（成交）总额	91,711,150.34

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	33,382.37
4	应收利息	860.01
5	应收申购款	172,436.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,678.70

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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
3,852	8,576.17	10,001,888.88	30.28%	23,033,525.41	69.72%

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	5,930.03	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 30 日）基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	35,780,561.15
本报告期基金总申购份额	113,690,370.33
减:本报告期基金总赎回份额	116,435,517.19
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	33,035,414.29

§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

2017 年 8 月, 陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金非基金中基金, 报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金更换会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙); 报告期支付给安永华明会计师事务所(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督部门稽查或处罚等情况。

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		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley & Co Intl Plc	-	189,519,274.26	100.00%	56,334.13	100.00%	-

注：1、本报告期内租用的证券公司交易单元没有发生变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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 1 月 1 日至 2017 年 2 月 27 日； 2017 年 6 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日	10,001,888.88	0.00	0.00	10,001,888.88	30.28%
	2	2017 年 3 月 29 日至 2017 年 5 月 19 日	0.00	21,228,402.07	21,228,402.07	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日