

长信中证一带一路主题指数分级证券投资  
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：广发证券股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## §1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”，下同）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	长信中证一带一路指数		
场内简称	带路分级		
基金主代码	502016		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 8 月 17 日		
基金管理人	长信基金管理有限责任公司		
基金托管人	广发证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	18,440,439.10 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	长信一带一路 A、长信一带一路 B: 2015 年 8 月 24 日; 长信一带一路份额: 2016 年 2 月 1 日		
下属分级基金的基金简称	长信一带一路 A	长信一带一路 B	长信一带一路
下属分级基金的场内简称	带路 A	带路 B	带路分级
下属分级基金的交易代码	502017	502018	502016
报告期末下属分级基金份额总额	1,026,359.00 份	1,026,359.00 份	16,387,721.10 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证一带一路主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证一带一路主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。长信一带一路份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平平均高于货币市场基金、债券型

	基金和混合型基金；长信一带一路 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；长信一带一路 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	长信一带一路 A	长信一带一路 B	长信一带一路
	预期风险低，预期收益低	预期风险高、预期收益高	预期风险较高、预期收益较高

### 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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	崔瑞娟
	联系电话	021-61009999	020-87555888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4007005566	95575
传真		021-61009800	020-87555129

### 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、广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 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 8 月 17 日 (基金合同生效日)- 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	538,750.23	-2,764,225.21	1,062,902.93
本期利润	-276,083.07	-2,854,648.10	1,821,698.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.1226	0.0333
本期基金份额净值增长率	2.01%	0.11%	6.70%
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	-0.0765	-0.0966	0.0367
期末基金资产净值	19,092,333.44	18,866,767.70	52,686,719.30
期末基金份额净值	1.035	1.037	1.059

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。

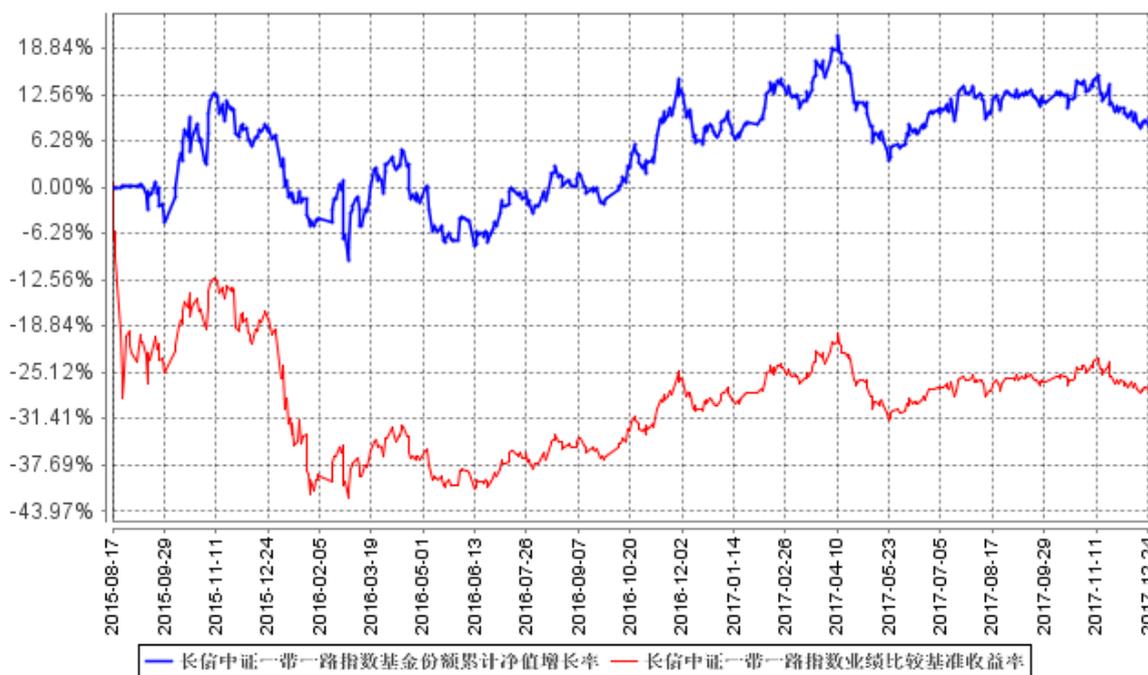
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

### 3.3 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	-2.33%	0.74%	-0.86%	0.76%	-1.47%	-0.02%
过去六个月	-1.23%	0.73%	0.45%	0.74%	-1.68%	-0.01%
过去一年	2.01%	0.80%	3.49%	0.82%	-1.48%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	8.96%	1.12%	-27.07%	1.59%	36.03%	-0.47%

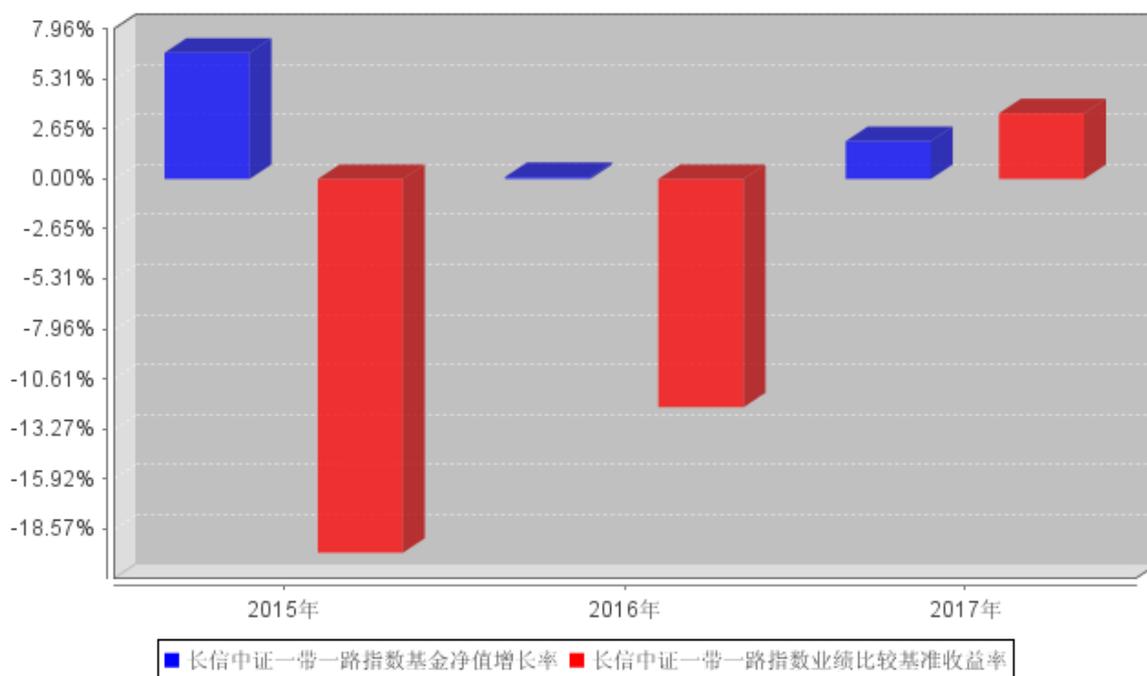
### 3.3.1 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2015 年 8 月 17 日至 2017 年 12 月 31 日。

2、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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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。

### 3.3.2 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 8 月 17 日，2015 年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.4 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 8 月 17 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		
左金保	长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信	2015 年 8 月 17 日	-	7 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任量化投资部总监、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合

	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				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。
邓虎	长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和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））的基金经理、FOF 投资部总监。	2015 年 8 月 26 日	-	7 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2015 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司 FOF 投资部总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和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））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，左金保先生不再担任长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理；

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

5、自 2018 年 2 月 6 日起，邓虎先生不再担任长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金和长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

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

7、自 2018 年 3 月 17 日起，宋海岸先生开始担任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金和长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）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。

本基金跟踪中证一带一路指数，标的指数表现本年度一般。本基金期间净值涨幅 2.01%，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，带路分级份额净值为 1.035 元，累计份额净值为 1.089 元。本报告期内本基金净值增长率为 2.01%，同期业绩比较基准收益率为 3.49%。

#### 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。

我们将继续根据指数进行投资，跟踪标的指数。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及其适用性的情况及时修订估

值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

在存续期内，本基金将不进行收益分配（除未来法律法规或监管机构允许的情况外）。本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后的新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### **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**

自 2016 年 4 月 13 日至 2016 年 7 月 8 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。2017 年 5 月 16 日，本基金资产净值高于五千万元。自 2017 年 5 月 17 日至 2017 年 8 月 10 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。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，本基金托管人在对长信中证一带一路主题指数分级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，长信中证一带一路主题指数分级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中证一带一路主题指数分级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，长信中证一带一路主题指数分级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的真实、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中证一带一路主题指数分级证券投资基金本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

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\_B11 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：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	1,532,292.40	1,967,434.22
结算备付金	1,071.36	75,866.88
存出保证金	10,883.69	12,224.61
交易性金融资产	17,946,357.91	17,089,525.52
其中：股票投资	17,946,357.91	17,089,525.52
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	287.99	383.24
应收股利	-	-
应收申购款	39,097.77	176,128.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,529,991.12	19,321,562.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	186,653.71	167,762.01
应付管理人报酬	16,506.89	16,496.55
应付托管费	3,631.53	3,629.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,162.52	11,275.28
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	225,703.03	255,632.21
负债合计	437,657.68	454,795.29
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	17,523,389.67	17,661,089.26
未分配利润	1,568,943.77	1,205,678.44
所有者权益合计	19,092,333.44	18,866,767.70
负债和所有者权益总计	19,529,991.12	19,321,562.99

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，带路分级份额净值 1.035 元，带路 A 份额净值 1.002 元，带路 B 份额净值 1.068 元；基金份额总额 18,440,439.10 份，其中带路分级份额 16,387,721.10 份，带路 A 份额 1,026,359.00 份，带路 B 份额 1,026,359.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	639,510.08	-2,020,221.20
1.利息收入	26,820.43	44,545.48
其中：存款利息收入	22,798.20	42,092.84
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	4,022.23	2,452.64
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,308,064.42	-2,105,390.15
其中：股票投资收益	919,459.71	-2,337,868.23
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	388,604.71	232,478.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-814,833.30	-90,422.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	119,458.53	131,046.36
<b>减：二、费用</b>	<b>915,593.15</b>	<b>834,426.90</b>
1. 管理人报酬	305,445.96	231,622.32
2. 托管费	67,198.15	50,956.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	107,589.04	99,630.43
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	435,360.00	452,217.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-276,083.07</b>	<b>-2,854,648.10</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-276,083.07</b>	<b>-2,854,648.10</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

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）	17,661,089.26	1,205,678.44	18,866,767.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-276,083.07	-276,083.07
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）	-137,699.59	639,348.40	501,648.81
其中：1. 基金申购款	85,393,688.07	10,639,625.78	96,033,313.85
2. 基金赎回款	-85,531,387.66	-10,000,277.38	-95,531,665.04
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）	17,523,389.67	1,568,943.77	19,092,333.44

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)	49,389,547.01	3,297,172.29	52,686,719.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,854,648.10	-2,854,648.10
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)	-31,728,457.75	763,154.25	-30,965,303.50
其中：1. 基金申购款	70,917,059.23	2,949,248.20	73,866,307.43
2. 基金赎回款	-102,645,516.98	-2,186,093.95	-104,831,610.93
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)	17,661,089.26	1,205,678.44	18,866,767.70

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

长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（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[2015]1212号文《关于准予长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年8月17日生效，首次设立募集规模为215,668,187.59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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金的基金份额包括长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额（即“长信

一带一路份额”）、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“长信一带一路 A 份额”）与长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“长信一带一路 B 份额”）。其中，长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。基金发售结束后，本基金将投资者在场内认购的全部长信一带一路份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额。基金合同生效后，长信一带一路份额接受场内与场外的申购和赎回，场内的长信一带一路份额在上海证券交易所上市交易。长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额只可在上海证券交易所上市交易，不接受申购或赎回。

每年的基金份额定期折算基准日（12 月 15 日，若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将按规则对长信一带一路 A 份额和长信一带一路份额进行定期份额折算。当长信一带一路份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，或当长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金还将进行不定期份额折算。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本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。

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证一带一路主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率}$ （税后）。

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《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》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 20 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

#### 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

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

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。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金托管人、基金代销机构
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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
广发证券	70,988,079.14	100.00%	64,134,283.58	100.00%

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
-------	---	---

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
广发证券	10,000,000.00	100.00%	30,000,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	66,112.75	100.00%	5,162.52	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	59,729.16	100.00%	11,275.28	100.00%

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。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	305,445.96
其中：支付销售机构的客户维护费	113,457.96	26,486.12

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

**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	67,198.15	50,956.85

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

**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：本基金本报告期末与上年度末均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	长信一带一路 A	长信一带一路 B	长信一带一路
基金合同生效日（2015 年 8 月 17 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		
	长信一带一路 A	长信一带一路 B	长信一带一路
基金合同生效日（2015 年 8 月 17 日）	-	-	-

持有的基金份额			
期初持有的基金份额	-	-	10,090,331.32
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	-	-	10,090,331.32
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。

#### 7.4.8.4.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### 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

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
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大资产重组	24.67	-	-	16,570	448,505.78	408,781.90	-
002524	光正集	2017	重大事	6.35	-	-	10,005	99,556.39	63,531.75	-

	团	年 12月 18日	项							
002738	中矿资源	2017 年 10月 9日	重大事 项	28.66	-	-	1,917	45,837.23	54,941.22	-

### 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	17,946,357.91	91.89
	其中：股票	17,946,357.91	91.89
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	1,533,363.76	7.85
8	其他各项资产	50,269.45	0.26
9	合计	19,529,991.12	100.00

注：本基金本报告期末未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 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,042,668.08	10.70
C	制造业	8,924,898.28	46.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,531.75	0.33
E	建筑业	4,143,326.25	21.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,435,955.61	12.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	281,036.72	1.47
J	金融业	-	-

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	54,941.22	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业		-
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	17,946,357.91	94.00

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

### 8.2.3 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股票投资明细

### 8.3.1 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	000063	中兴通讯	19,592	712,365.12	3.73
2	601766	中国中车	56,972	689,930.92	3.61
3	600031	三一重工	68,100	617,667.00	3.24
4	600028	中国石化	97,118	595,333.34	3.12
5	601390	中国中铁	70,043	587,660.77	3.08
6	601857	中国石油	72,608	587,398.72	3.08
7	601989	中国重工	96,744	583,366.32	3.06
8	600089	特变电工	56,200	556,942.00	2.92
9	601668	中国建筑	61,005	550,265.10	2.88
10	002202	金风科技	29,187	550,174.95	2.88

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。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 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	601668	中国建筑	1,675,050.00	8.88
2	601669	中国电建	1,366,690.00	7.24
3	600028	中国石化	1,297,964.00	6.88
4	601186	中国铁建	1,204,386.00	6.38
5	601989	中国重工	1,202,898.00	6.38
6	600068	葛洲坝	1,189,230.58	6.30
7	601766	中国中车	1,162,494.00	6.16
8	601390	中国中铁	1,156,543.00	6.13
9	600089	特变电工	1,080,849.00	5.73
10	601857	中国石油	1,069,073.00	5.67
11	000063	中兴通讯	1,046,693.00	5.55
12	600031	三一重工	1,021,449.00	5.41
13	601800	中国交建	995,532.00	5.28
14	002202	金风科技	937,540.00	4.97
15	601866	中远海发	882,228.00	4.68
16	600522	中天科技	846,669.16	4.49
17	601018	宁波港	799,938.00	4.24
18	000157	中联重科	778,266.00	4.13
19	600018	上港集团	725,089.00	3.84
20	600487	亨通光电	708,311.33	3.75
21	600150	中国船舶	681,933.00	3.61
22	600820	隧道股份	658,772.00	3.49
23	000425	徐工机械	647,742.00	3.43
24	600118	中国卫星	614,792.00	3.26
25	600583	海油工程	605,493.00	3.21
26	601117	中国化学	566,470.00	3.00
27	600256	广汇能源	530,892.00	2.81
28	002092	中泰化学	461,305.00	2.45
29	601179	中国西电	459,648.00	2.44
30	600528	中铁工业	399,866.00	2.12
31	600759	洲际油气	379,353.00	2.01

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	601668	中国建筑	1,982,953.28	10.51
2	000063	中兴通讯	1,817,913.24	9.64
3	601669	中国电建	1,455,998.25	7.72
4	600028	中国石化	1,373,937.85	7.28
5	600089	特变电工	1,104,907.21	5.86
6	601186	中国铁建	1,093,356.65	5.80
7	600031	三一重工	1,091,046.46	5.78
8	600068	葛洲坝	1,079,051.52	5.72
9	601766	中国中车	1,051,026.20	5.57
10	002202	金风科技	1,043,932.45	5.53
11	601390	中国中铁	1,039,681.08	5.51
12	600018	上港集团	1,010,332.40	5.36
13	600522	中天科技	988,008.49	5.24
14	601989	中国重工	971,225.15	5.15
15	601857	中国石油	968,955.37	5.14
16	601018	宁波港	960,652.77	5.09
17	601800	中国交建	789,267.20	4.18
18	601866	中远海发	749,472.22	3.97
19	000157	中联重科	665,715.34	3.53
20	600487	亨通光电	664,899.22	3.52
21	000425	徐工机械	552,964.88	2.93
22	600970	中材国际	509,944.16	2.70
23	600820	隧道股份	508,032.11	2.69
24	600150	中国船舶	495,004.32	2.62
25	600583	海油工程	484,381.84	2.57
26	600118	中国卫星	469,505.65	2.49
27	601117	中国化学	467,515.76	2.48
28	600256	广汇能源	442,050.70	2.34
29	600312	平高电气	440,250.39	2.33
30	002092	中泰化学	413,964.92	2.19

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	35,930,578.49
卖出股票收入（成交）总额	35,178,372.51

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	10,883.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	287.99
5	应收申购款	39,097.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,269.45

### 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债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

### **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
长信一带一路 A	57	18,006.30	11,071.00	1.08%	1,015,288.00	98.92%
长信一带一路 B	106	9,682.63	44,178.00	4.30%	982,181.00	95.70%
长信一带一路	3,506	4,674.19	8,294.00	0.05%	16,379,427.10	99.95%
合计	3,669	5,026.01	63,543.00	0.34%	18,376,896.10	99.66%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

带路 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	黄英	207,437.00	20.21%
2	杨启明	78,900.00	7.69%
3	胡建彬	74,378.00	7.25%
4	郭曼	50,000.00	4.87%
5	庞万里	49,569.00	4.83%
6	黄晖	43,773.00	4.26%
7	钱中明	36,200.00	3.53%
8	李彩云	25,248.00	2.46%
9	肖沐龙	24,954.00	2.43%
10	鄢妮	24,792.00	2.42%

注：持有人为场内持有人。

带路 B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	曹辉	86,245.00	8.40%
2	胡建彬	74,378.00	7.25%
3	刘京	53,223.00	5.19%
4	譙玉芳	50,000.00	4.87%
5	黄楚雄	42,494.00	4.14%
6	杨龙山	30,300.00	2.95%
7	曾文玲	27,200.00	2.65%

8	李彩云	25,248.00	2.46%
9	傅晓露	25,217.00	2.46%
10	黄咏梅	25,200.00	2.46%

注：持有人为场内持有人。

#### 带路分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	岳国利	104,146.00	24.10%
2	戴兰青	44,245.00	10.24%
3	张睿	39,571.00	9.16%
4	丁忠平	29,957.00	6.93%
5	胡永智	27,830.00	6.44%
6	曾亭曦	15,725.00	3.64%
7	吕美芳	14,203.00	3.29%
8	孙坤瑗	10,441.00	2.42%
9	王辉	9,196.00	2.13%
10	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍盛稳进	8,200.00	1.90%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 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	长信一带一路 A	0.00	0.00%
	长信一带一路 B	0.00	0.00%
	长信一带一路	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

### 9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信一带一路 A	0
	长信一带一路 B	0
	长信一带一路	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信一带一路 A	0
	长信一带一路 B	0
	长信一带一路	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信一带一路 A	长信一带一路 B	长信一带一路
基金合同生效日（2015 年 8 月 17 日）基金份额总额	85,699,609.00	85,699,609.00	215,668,187.59
本报告期期初基金份额总额	2,332,659.00	2,332,659.00	13,526,528.31
本报告期基金总申购份额	-	-	87,965,975.46
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	88,112,045.05
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-1,306,300.00	-1,306,300.00	3,007,262.38
本报告期末基金份额总额	1,026,359.00	1,026,359.00	16,387,721.10

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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

报告期本基金改聘为基金审计的会计师事务所。报告期应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 5 万元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金管理人、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		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	
广发证券	2	70,988,079.14	100.00%	66,112.75	100.00%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化情况如下：

新增租用海通证券、财通证券交易单元各 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：

- 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2017 年 2 月 21 日至 2017 年 3 月 21 日	0.00	13,908,338.94	13,908,338.94	0.00	0.00%
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。

长信基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日