

长信量化多策略股票型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2020 年 4 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61

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.....	62
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.....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12 投资组合报告附注.....	62
§ 9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 10 开放式基金份额变动.....	65
§ 11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8 其他重大事件.....	68
§ 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	106,717,626.90 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	69,285,250.09 份	37,432,376.81 份

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	沪深 300 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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.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	北京市西城区复兴门内大街 55

	68 号 9 楼	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	成善栋	陈四清

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
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
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司、C 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号、C 类份额：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	2019 年		2018 年		2017 年	
	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	17,394,317. 66	541,928.53	-35,303,151. 76	-76,562.6 9	-10,682,004. 19	-6,777.73
本期 利 润	30,575,488. 36	926,348.25	-36,778,655. 53	-60,667.5 0	-8,698,531.3 4	-5,948.29
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.3452	1.5163	-0.3004	-0.3144	-0.0406	-0.0455
本 期 加 权 平	30.68%	129.66%	-26.38%	-28.64%	-3.26%	-3.60%

均 净 值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	35.89%	34.21%	-25.82%	-26.51%	-1.73%	3.66%
3.1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	17,823,008. 94	264,455.97	-6,372,156.9 2	-37,574.3 3	39,808,923.2 2	41,217.62
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利	0.2572	0.0071	-0.0749	-0.1737	0.2474	0.1948

润						
期末基金资产净值	87,108,259.03	45,978,953.96	78,678,264.21	197,886.59	200,731,254.24	263,481.22
期末基金份额净值	1.257	1.228	0.925	0.915	1.247	1.245
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	25.70%	2.25%	-7.50%	-23.81%	24.70%	3.66%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.14%	0.81%	6.16%	0.59%	4.98%	0.22%
过去六个月	11.93%	0.89%	6.25%	0.68%	5.68%	0.21%
过去一年	35.89%	1.19%	29.52%	0.99%	6.37%	0.20%
过去三年	-0.95%	1.18%	-8.14%	0.99%	7.19%	0.19%
自基金合同生效起至今	25.70%	1.57%	-19.84%	1.34%	45.54%	0.23%

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	10.83%	0.80%	6.16%	0.59%	4.67%	0.21%
过去六个月	11.13%	0.88%	6.25%	0.68%	4.88%	0.20%
过去一年	34.21%	1.19%	29.52%	0.99%	4.69%	0.20%
自份额增加日起至今 (2017年7月20日-2019年12月31日)	2.25%	1.20%	-5.84%	1.04%	8.09%	0.16%

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



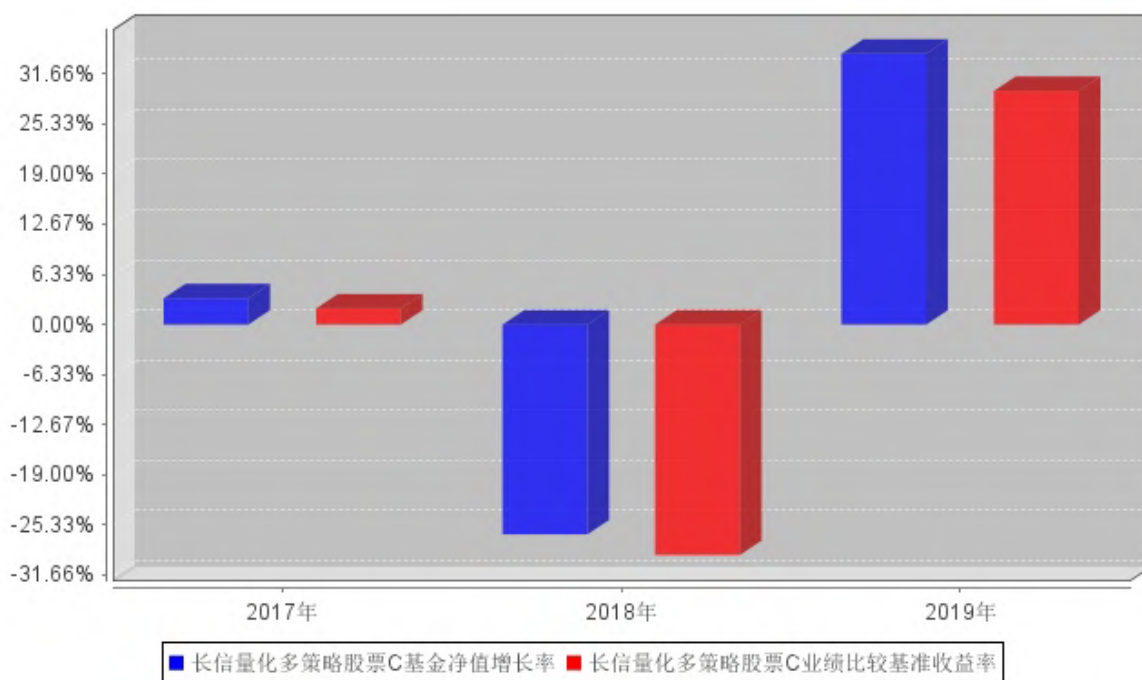
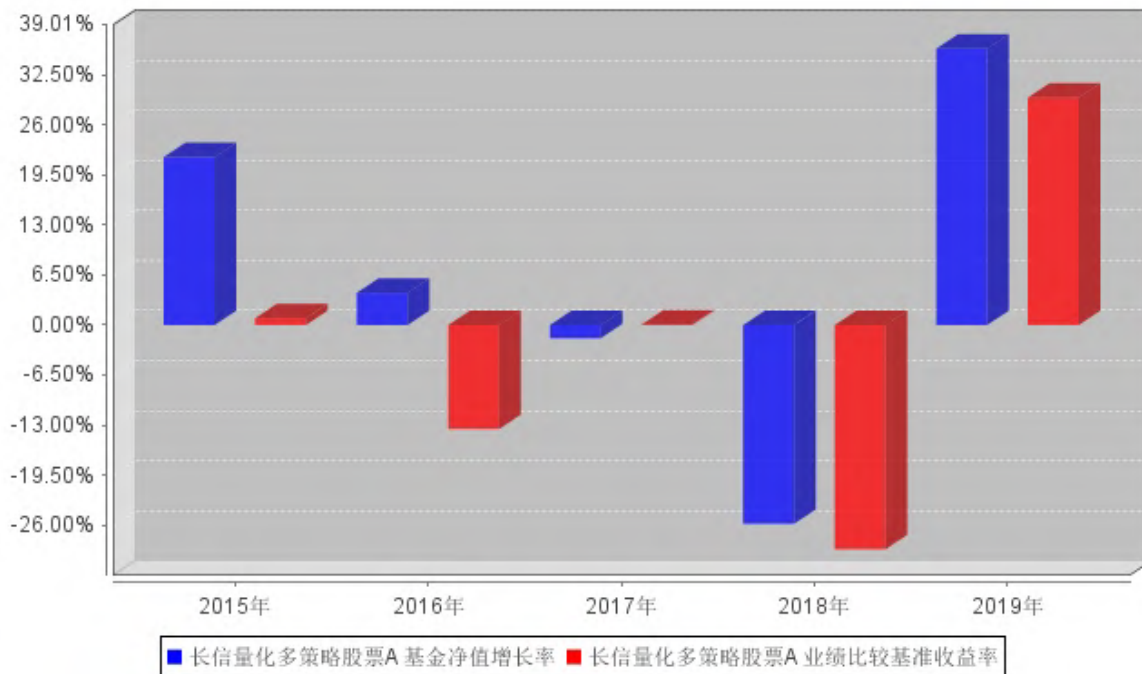
注：1、基金管理人自 2017 年 7 月 20 日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信量化多策略股票 A 图示日期为 2015 年 7 月 14 日至 2019 年 12 月 31 日，长信量化多策略股票 C 图示日期为 2017 年 7 月 20 日（份额增加日）至 2019 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：长信量化多策略股票 C 图示份额计算期间为自份额增加日 2017 年 7 月 20 日至 2019 年 12 月 31 日，2017 年净值增长率按长信量化多策略股票 C 份额实际存续期计算。

长信量化多策略股票 A 份额基金合同生效日为 2015 年 7 月 14 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 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 66 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、长信长金通货币市场基金、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、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式

证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监兼量	2018 年 8 月 31 日	-	9 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。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略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、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置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

	化研究部总监、 投资决策委员会 执行委员			资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动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和长信沪深 300 指数增强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；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

2019 年中国经济整体运行平稳，货币政策实施稳健，工业生产和终端消费都在低水平盘整。CPI 由于猪价等原因大幅上行，造成了 CPI-PPI 剪刀差持续走阔。国际关系角度，中美贸易战已经进入持久战状态，短期冲击变弱，长期影响变强，这也给政府和企业足够的时间来调整自身的战略。A 股市场在经历了 2018 年系统性下跌后，估值在相对低位，在 2019 年迎来了全面反弹，各大宽基指数全线上涨，整体涨幅大致在 30%~50% 之间，其中创业板表现最出色，投资者风险偏好明显提升。从整体风格上看，靠近下游消费的行业表现更优异，如食品饮料、家电、电子等，而靠近上游资源的行业表现相对较差，如钢铁、煤炭等。同时由于风险偏好提升，诸如高股息等低风险策略吸引力下降，表现不佳，而诸如成长股等高风险策略吸引力提升，表现优异。2019 年我们持续对量化模型和投资组合改进优化，在继续坚持行业均衡、风格分散原则下，加强对财务因子和分析师一致预期数据的研究，进一步改进增强模型的适应能力和应变能力，力争为投资者获取长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，长信量化多策略股票 A 份额净值为 1.257 元，份额累计净值为 1.257 元，本报告期内长信量化多策略股票 A 净值增长率为 35.89%，同期业绩比较基准收益率为 29.52%；长信量化多策略股票 C 份额净值为 1.228 元，份额累计净值为 1.228 元，本报告期内长信量化多策略股票 C 净值增长率为 34.21%，同期业绩比较基准收益率为 29.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年,新冠疫情给原本就艰难的宏观经济增加了新的挑战,全球经济均存在失速风险,所以未来货币政策和财政政策的走向至关重要。当前全球主要经济体都选择降息来对冲经济潜在下行风险,接下来中国或在货币政策和财政政策两端发力,在国内疫情得到有效控制后,企稳反弹的政府投资和民间投资以及各项稳消费的政策出台也将给中国经济和资本市场注入新的动力。放眼国际,中美贸易冲突将长期存在,全球经济下滑的局面也使得各国政府采取更为宽松的宏观政策,未来几年将是中国经济结构转型和产业升级的重要窗口期。此外,A股加速国际化也在催生资本市场的变革,长远来看未来的投资主体将更加机构化和专业化,市场参与者将更加注重基本面的分析判断,而我们对于模型的改进和和优化也更注重盈利和成长等基本面因子的分析。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,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,力争为投资者获取长期稳健的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本年度内,为确保监管要求的有效实施,公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况,积极开展公司业务流程及风险梳理的工作,及时组织召开内部控制委员会会议,对新规要求进行解读,并依照新规要求,对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨,并加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内,监察稽核部以组合压力测试为主要方式,定期对投资组合的风险状况进行检测的机制,对投资组合整体流动性情况进行分析,并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论,防范系统性风险事件的发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则,秉持内控优先、内控从严的理念,不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系,做好各项内控工作,努力防范和控制各种风险,确保基金资产的规范运作,充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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量化多策略股票型证券投资基金 2019 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(20)第 P00063 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持有人
审计意见	<p>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 2019 年 12 月 31 日的资产负债表, 2019 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。</p> <p>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 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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 2019 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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</p>

	<p>(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。</p> <p>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。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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(包括披露)、结构和内容，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	冯适
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	2020 年 4 月 22 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	24,858,513.44	7,071,500.04
结算备付金		260,853.73	720,726.73
存出保证金		30,306.87	40,789.48
交易性金融资产	7.4.7.2	128,682,124.07	71,536,901.54
其中：股票投资		123,072,757.07	71,536,901.54
基金投资		-	-
债券投资		5,609,367.00	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	155,064.61	1,781.66
应收股利		-	-
应收申购款		11,910.54	18,708.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		153,998,773.26	79,390,407.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 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		20,177,788.74	-
应付赎回款		284,506.76	3,144.93
应付管理人报酬		163,230.64	103,092.00
应付托管费		27,205.08	17,182.01
应付销售服务费		4,130.47	178.22
应付交易费用	7.4.7.7	144,446.42	180,654.57
应交税费		0.35	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	110,251.81	210,005.07
负债合计		20,911,560.27	514,256.80
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	106,717,626.90	85,266,729.29
未分配利润	7.4.7.10	26,369,586.09	-6,390,578.49
所有者权益合计		133,087,212.99	78,876,150.80
负债和所有者权益总计		153,998,773.26	79,390,407.60

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，长信量化多策略股票 A 基金份额净值 1.257 元，基金份额总额 69,285,250.09 份；长信量化多策略股票 C 基金份额净值 1.228 元，基金份额总额 37,432,376.81 份。长信量化多策略股票份额总额合计为 106,717,626.90 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		34,601,783.23	-32,778,148.27
1.利息收入		75,884.90	141,385.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	54,717.60	141,385.01
债券利息收入		21,167.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,819,990.48	-31,556,825.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,401,821.51	-33,718,541.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	1,418,168.97	2,161,716.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,565,590.42	-1,459,608.58
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	140,317.43	96,900.43
减：二、费用		3,099,946.62	4,061,174.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,504,929.63	2,090,910.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	250,821.55	348,485.27
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,017.59	2,114.49
4. 交易费用	7.4.7.19	1,226,501.80	1,409,048.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	-
7. 其他费用	7.4.7.20	110,676.00	210,616.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,501,836.61	-36,839,323.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,501,836.61	-36,839,323.03

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：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	85,266,729.29	-6,390,578.49	78,876,150.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,501,836.61	31,501,836.61
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）	21,450,897.61	1,258,327.97	22,709,225.58
其中：1. 基金申购款	90,179,209.94	14,372,274.13	104,551,484.07
2. 基金赎回款	-68,728,312.33	-13,113,946.16	-81,842,258.49
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）	106,717,626.90	26,369,586.09	133,087,212.99
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	161,133,973.80	39,860,761.66	200,994,735.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,839,323.03	-36,839,323.03
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）	-75,867,244.51	-9,412,017.12	-85,279,261.63
其中：1. 基金申购款	17,383,507.77	2,421,394.14	19,804,901.91
2. 基金赎回款	-93,250,752.28	-11,833,411.26	-105,084,163.54
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）	85,266,729.29	-6,390,578.49	78,876,150.80

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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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自 2018 年 10 月 22 日起由原“中证 500 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、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。

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扣代缴金额确认。

- 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 1.00%的年费率逐日计提。

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)相关规定,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

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续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的公告》、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、债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	24,858,513.44	7,071,500.04
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计:	24,858,513.44	7,071,500.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,461,266.76	123,072,757.07	10,611,490.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,589,787.00	5,609,367.00
	银行间市场	-	-

	合计	5,589,787.00	5,609,367.00	19,580.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		118,051,053.76	128,682,124.07	10,631,070.31
项目	上年度末 2018年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	74,471,421.65	71,536,901.54	-2,934,520.11	
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	74,471,421.65	71,536,901.54	-2,934,520.11	

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未持有衍生金融工具。

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未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	3,690.56	1,439.06
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	117.40	324.30
应收债券利息	151,242.95	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	-	-

应收出借证券利息	-	-
其他	13.70	18.30
合计	155,064.61	1,781.66

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	144,446.42	180,654.57
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	144,446.42	180,654.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	251.81	5.07
应付证券出借违约金	-	-
预提账户维护费	-	-
预提审计费	30,000.00	30,000.00
预提信息披露费	80,000.00	180,000.00
合计	110,251.81	210,005.07

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 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,050,421.13	85,050,421.13
本期申购	52,035,091.23	52,035,091.23
本期赎回（以“-”号填列）	-67,800,262.27	-67,800,262.27
- 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	69,285,250.09	69,285,250.09

金额单位：人民币元

长信量化多策略股票 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	216,308.16	216,308.16
本期申购	38,144,118.71	38,144,118.71
本期赎回（以“-”号填列）	-928,050.06	-928,050.06
- 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	37,432,376.81	37,432,376.81

注：本期申购含红利再投、转换入份(金额)，本期赎回含转换出份(金额)。

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	9,271,601.94	-15,643,758.86	-6,372,156.92
本期利润	17,394,317.66	13,181,170.70	30,575,488.36
本期基金份额交易产生的变动数	-5,463,195.43	-917,127.07	-6,380,322.50
其中：基金申购款	11,514,160.44	-4,932,736.73	6,581,423.71
基金赎回款	-16,977,355.87	4,015,609.66	-12,961,746.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,202,724.17	-3,379,715.23	17,823,008.94

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	-37,574.33	19,152.76	-18,421.57
本期利润	541,928.53	384,419.72	926,348.25
本期基金份额交易产生的变动数	-239,898.23	7,878,548.70	7,638,650.47
其中：基金申购款	-272,067.02	8,062,917.44	7,790,850.42
基金赎回款	32,168.79	-184,368.74	-152,199.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	264,455.97	8,282,121.18	8,546,577.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	46,245.79	133,085.95
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	6,950.37	7,507.38
其他	1,521.44	791.68
合计	54,717.60	141,385.01

注：其他为在途利息收入和保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	484,349,758.67	614,139,256.40
减：卖出股票成本总额	464,947,937.16	647,857,797.70
买卖股票差价收入	19,401,821.51	-33,718,541.30

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,418,168.97	2,161,716.17
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,418,168.97	2,161,716.17

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	13,565,590.42	-1,459,608.58
——股票投资	13,546,010.42	-1,459,608.58
——债券投资	19,580.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值 税	-	-
合计	13,565,590.42	-1,459,608.58

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日

基金赎回费收入	140,256.72	96,092.63
基金转换费收入	60.71	807.80
合计	140,317.43	96,900.43

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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	1,226,501.80	1,409,048.07
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,226,501.80	1,409,048.07

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	180,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	676.00	616.00
合计	110,676.00	210,616.00

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	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、基金销售机构
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
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	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
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间无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：本基金本报告期内及上年度可比期间无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：本基金本报告期内及上年度可比期间无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：本基金本报告期内及上年度可比期间无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：本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,504,929.63	2,090,910.93
其中：支付销售机构的客户维护费	573,797.67	716,882.53

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	250,821.55	348,485.27

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		
	2019年1月1日至2019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	-	4,000.90	4,000.90
合计	-	4,000.90	4,000.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018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	-	287.44	287.44
合计	-	287.44	287.44

注：根据基金合同的规定，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：本基金本报告期内及上年度可比期间无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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	24,858,513.44	46,245.79	7,071,500.04	133,085.95

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 2019 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 260,853.73 元(2018 年 12 月 31 日：相关余额为人民币 720,726.73 元)。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 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
688037	芯源微	2019年12月6日	2020年6月16日	新股锁定	26.97	58.98	3,028	81,665.16	178,591.44	-
688123	聚辰股份	2019年12月16日	2020年6月23日	新股锁定	33.25	58.12	2,664	88,578.00	154,831.68	-
688078	龙软科技	2019年12月20日	2020年6月30日	新股锁定	21.59	41.95	2,670	57,645.30	112,006.50	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	1,674	73,622.52	73,622.52	-
688081	兴图	2019	2020	新股流	28.21	28.21	2,260	63,754.60	63,754.60	-

	新科	年 12 月 26 日	年 1 月 6 日	通受限						
002973	侨银 环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股流 通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688198	佰仁 医疗	2019 年 11 月 29 日	2020 年 6 月 9 日	新股锁 定	23.68	37.58	3,213	76,083.84	120,744.54	-
688300	联瑞 新材	2019 年 11 月 7 日	2020 年 5 月 15 日	新股锁 定	27.28	39.84	3,164	86,313.92	126,053.76	-
688310	迈得 医疗	2019 年 11 月 22 日	2020 年 6 月 3 日	新股锁 定	24.79	27.12	3,276	81,212.04	88,845.12	-
688363	华熙 生物	2019 年 10 月 28 日	2020 年 5 月 6 日	新股锁 定	47.79	72.00	6,370	304,422.30	458,640.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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，战略与产品研发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人中国工商银行，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：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	77,467.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	5,531,900.00	0.00
合计	5,609,367.00	0.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	24,858,513.44	-	-	-	-	24,858,513.44
结算备付金	260,853.73	-	-	-	-	260,853.73
存出保证金	30,306.87	-	-	-	-	30,306.87
交易性金融资产	5,531,900.00	77,467.00	-	-	-123,072,757.07	128,682,124.07
应收利息	-	-	-	-	155,064.61	155,064.61
应收申购款	-	-	-	-	11,910.54	11,910.54
资产总计	30,681,574.04	77,467.00	-	-	-123,239,732.22	153,998,773.26
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	20,177,788.74	20,177,788.74
应付赎回款	-	-	-	-	284,506.76	284,506.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	163,230.64	163,230.64
应付托管费	-	-	-	-	27,205.08	27,205.08
应付销售服务费	-	-	-	-	4,130.47	4,130.47
应付交易费用	-	-	-	-	144,446.42	144,446.42
应交税费	-	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	-	110,251.81	110,251.81
负债总计	-	-	-	-	20,911,560.27	20,911,560.27
利率敏感度缺口	30,681,574.04	77,467.00	-	-	-102,328,171.95	133,087,212.99
上年度末 2018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	7,071,500.04	-	-	-	-	7,071,500.04
结算备付金	720,726.73	-	-	-	-	720,726.73
存出保证金	40,789.48	-	-	-	-	40,789.48
交易性金融资产	-	-	-	-	71,536,901.54	71,536,901.54

应收利息	-	-	-	1,781.66	1,781.66
应收申购款	-	-	-	18,708.15	18,708.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,833,016.25	-	-	71,557,391.35	79,390,407.60
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,144.93	3,144.93
应付管理人报酬	-	-	-	103,092.00	103,092.00
应付托管费	-	-	-	17,182.01	17,182.01
应付销售服务费	-	-	-	178.22	178.22
应付交易费用	-	-	-	180,654.57	180,654.57
其他负债	-	-	-	210,005.07	210,005.07
负债总计	-	-	-	514,256.80	514,256.80
利率敏感度缺口	7,833,016.25	-	-	71,043,134.55	78,876,150.80

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降27个基点	5,657.83	0.00
	市场利率上升27个基点	-5,657.83	0.00

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于12月31日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	123,072,757.07	92.48	71,536,901.54	90.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,609,367.00	4.21	-	-
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	128,682,124.07	96.69	71,536,901.54	90.70

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.55%（2018 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.27%）	-4,721,944.41	-2,576,267.68

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。2018 年的分析同样基于该假设。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层次的余额为人民币 121,766,555.87 元,属于第二层次的余额为人民币 5,675,855.16 元,属于第三层次的余额为人民币 1,239,713.04 元(于 2018 年 12 月 31 日,第一层次的余额为人民币 71,536,901.54 元,无属于第二层次和第三层次的余额)。

(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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下:

上年度末余额为人民币 0.00 元,本期转入第三层次金额为人民币 0.00 元,转出第三层次金额为人民币 0.00 元,当期计入损益的利得或损失总额为人民币 463,792.48 元,本期购买金额为人民币 775,920.56 元,出售金额为人民币 0.00 元,本期末余额为人民币 1,239,713.04 元,本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 463,792.48 元。

(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	123,072,757.07	79.92
	其中：股票	123,072,757.07	79.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,609,367.00	3.64
	其中：债券	5,609,367.00	3.64
	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	25,119,367.17	16.31
8	其他各项资产	197,282.02	0.13
9	合计	153,998,773.26	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	4,047,515.00	3.04
B	采矿业	1,904,640.00	1.43
C	制造业	54,647,119.99	41.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,112,188.00	0.84
F	批发和零售业	90,600.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,825,824.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	928,548.50	0.70
J	金融业	44,281,582.12	33.27
K	房地产业	8,242,935.00	6.19
L	租赁和商务服务业	1,965,982.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	1,909,404.42	1.43

N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,109,840.00	1.59
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	123,072,757.07	92.48

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	74,322	6,351,558.12	4.77
2	600036	招商银行	165,100	6,204,458.00	4.66
3	601166	兴业银行	267,400	5,294,520.00	3.98
4	000333	美的集团	87,300	5,085,225.00	3.82
5	600276	恒瑞医药	50,900	4,454,768.00	3.35
6	000002	万科 A	129,800	4,176,964.00	3.14
7	002475	立讯精密	108,800	3,971,200.00	2.98
8	600519	贵州茅台	3,005	3,554,915.00	2.67
9	000001	平安银行	205,700	3,383,765.00	2.54
10	300498	温氏股份	98,000	3,292,800.00	2.47
11	000858	五粮液	24,000	3,192,240.00	2.40
12	600030	中信证券	121,600	3,076,480.00	2.31
13	601688	华泰证券	140,800	2,859,648.00	2.15
14	601628	中国人寿	81,800	2,852,366.00	2.14
15	601818	光大银行	600,000	2,646,000.00	1.99
16	600837	海通证券	160,000	2,473,600.00	1.86
17	000661	长春高新	5,500	2,458,500.00	1.85
18	600346	恒力石化	151,100	2,429,688.00	1.83
19	002607	中公教育	118,000	2,109,840.00	1.59
20	300014	亿纬锂能	42,000	2,106,720.00	1.58
21	603606	东方电缆	188,100	2,065,338.00	1.55
22	600466	蓝光发展	280,000	2,063,600.00	1.55
23	000568	泸州老窖	23,600	2,045,648.00	1.54
24	002146	荣盛发展	203,700	2,002,371.00	1.50
25	002127	南极电商	180,200	1,965,982.00	1.48

26	600643	爱建集团	203,800	1,956,480.00	1.47
27	300130	新国都	110,000	1,939,300.00	1.46
28	603658	安图生物	20,000	1,927,600.00	1.45
29	300012	华测检测	128,062	1,909,404.42	1.43
30	601808	中海油服	99,200	1,904,640.00	1.43
31	601021	春秋航空	41,600	1,825,824.00	1.37
32	002271	东方雨虹	66,000	1,736,460.00	1.30
33	603986	兆易创新	8,200	1,680,098.00	1.26
34	603160	汇顶科技	8,000	1,650,400.00	1.24
35	601229	上海银行	170,000	1,613,300.00	1.21
36	000876	新希望	80,000	1,596,000.00	1.20
37	601009	南京银行	180,000	1,578,600.00	1.19
38	300059	东方财富	99,200	1,564,384.00	1.18
39	002798	帝欧家居	60,600	1,518,030.00	1.14
40	601058	赛轮轮胎	320,000	1,430,400.00	1.07
41	002353	杰瑞股份	37,600	1,389,696.00	1.04
42	002810	山东赫达	70,244	1,362,733.60	1.02
43	002236	大华股份	68,000	1,351,840.00	1.02
44	600809	山西汾酒	13,500	1,210,950.00	0.91
45	601601	中国太保	31,400	1,188,176.00	0.89
46	000651	格力电器	18,000	1,180,440.00	0.89
47	601117	中国化学	172,700	1,112,188.00	0.84
48	603737	三棵树	13,600	1,096,840.00	0.82
49	002714	牧原股份	8,500	754,715.00	0.57
50	002142	宁波银行	25,700	723,455.00	0.54
51	600926	杭州银行	56,200	514,792.00	0.39
52	600612	老凤祥	9,800	466,578.00	0.35
53	300496	中科创达	10,300	464,942.00	0.35
54	688363	华熙生物	6,370	458,640.00	0.34
55	603288	海天味业	4,100	440,791.00	0.33
56	300559	佳发教育	12,000	351,600.00	0.26
57	688037	芯源微	3,028	178,591.44	0.13
58	688123	聚辰股份	2,664	154,831.68	0.12
59	688300	联瑞新材	3,164	126,053.76	0.09
60	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.09
61	688078	龙软科技	2,670	112,006.50	0.08
62	002697	红旗连锁	12,000	90,600.00	0.07
63	688310	迈得医疗	3,276	88,845.12	0.07
64	688181	八亿时空	1,674	73,622.52	0.06

65	688081	兴图新科	2,260	63,754.60	0.05
66	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
67	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
68	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	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	601166	兴业银行	7,345,411.06	9.31
2	601688	华泰证券	6,629,162.89	8.40
3	601288	农业银行	6,291,993.00	7.98
4	601668	中国建筑	5,663,192.00	7.18
5	601328	交通银行	5,450,171.00	6.91
6	300498	温氏股份	5,428,107.00	6.88
7	000858	五粮液	5,418,305.80	6.87
8	601818	光大银行	5,323,443.00	6.75
9	601117	中国化学	5,140,966.00	6.52
10	601628	中国人寿	4,946,658.98	6.27
11	300003	乐普医疗	4,865,761.83	6.17
12	600036	招商银行	4,792,143.00	6.08
13	601229	上海银行	4,737,352.00	6.01
14	600837	海通证券	4,691,503.00	5.95
15	600606	绿地控股	4,668,027.84	5.92
16	600887	伊利股份	4,540,139.86	5.76
17	000333	美的集团	4,529,492.60	5.74
18	600999	招商证券	4,393,869.00	5.57
19	000596	古井贡酒	4,333,982.00	5.49
20	000338	潍柴动力	4,317,494.82	5.47
21	002475	立讯精密	4,270,843.00	5.41
22	000568	泸州老窖	4,103,342.00	5.20
23	002415	海康威视	4,092,401.00	5.19
24	603288	海天味业	4,070,373.00	5.16
25	600031	三一重工	4,067,478.00	5.16
26	000001	平安银行	4,062,642.00	5.15

27	600276	恒瑞医药	4,057,913.00	5.14
28	002271	东方雨虹	3,918,076.40	4.97
29	000002	万科 A	3,821,763.00	4.85
30	000157	中联重科	3,664,049.00	4.65
31	600030	中信证券	3,644,609.00	4.62
32	000661	长春高新	3,640,567.00	4.62
33	601881	中国银河	3,415,311.00	4.33
34	601939	建设银行	3,414,279.00	4.33
35	000425	徐工机械	3,400,291.00	4.31
36	600519	贵州茅台	3,349,805.00	4.25
37	000963	华东医药	3,302,828.60	4.19
38	600637	东方明珠	3,298,535.27	4.18
39	601998	中信银行	3,298,417.00	4.18
40	600346	恒力石化	3,294,220.80	4.18
41	300012	华测检测	3,290,912.60	4.17
42	002065	东华软件	3,117,531.96	3.95
43	601169	北京银行	3,112,055.25	3.95
44	601377	兴业证券	2,958,739.00	3.75
45	600048	保利地产	2,944,374.00	3.73
46	601788	光大证券	2,920,832.00	3.70
47	600809	山西汾酒	2,920,010.00	3.70
48	002353	杰瑞股份	2,854,808.00	3.62
49	002352	顺丰控股	2,851,660.00	3.62
50	002236	大华股份	2,839,192.00	3.60
51	603444	吉比特	2,794,398.00	3.54
52	002146	荣盛发展	2,758,849.00	3.50
53	601009	南京银行	2,748,144.00	3.48
54	600958	东方证券	2,714,115.00	3.44
55	601336	新华保险	2,664,223.00	3.38
56	000063	中兴通讯	2,641,385.25	3.35
57	600351	亚宝药业	2,604,703.40	3.30
58	600170	上海建工	2,593,699.00	3.29
59	300122	智飞生物	2,567,994.00	3.26
60	601012	隆基股份	2,509,117.00	3.18
61	000709	河钢股份	2,497,345.00	3.17
62	002714	牧原股份	2,464,124.00	3.12

63	600588	用友网络	2,378,788.01	3.02
64	300059	东方财富	2,367,932.06	3.00
65	600339	中油工程	2,342,163.00	2.97
66	000895	双汇发展	2,324,518.00	2.95
67	000876	新希望	2,320,950.00	2.94
68	600566	济川药业	2,290,617.00	2.90
69	000630	铜陵有色	2,197,545.00	2.79
70	601888	中国国旅	2,143,045.00	2.72
71	002111	威海广泰	2,132,807.00	2.70
72	002607	中公教育	2,129,600.00	2.70
73	603606	东方电缆	2,086,054.00	2.64
74	600757	长江传媒	2,075,220.00	2.63
75	002127	南极电商	2,041,662.00	2.59
76	601211	国泰君安	2,033,162.00	2.58
77	603160	汇顶科技	2,023,520.00	2.57
78	600643	爱建集团	2,011,451.96	2.55
79	000423	东阿阿胶	2,006,986.00	2.54
80	300014	亿纬锂能	1,986,133.00	2.52
81	300130	新国都	1,981,136.00	2.51
82	002304	洋河股份	1,962,355.00	2.49
83	601808	中海油服	1,958,734.00	2.48
84	603658	安图生物	1,945,278.00	2.47
85	600909	华安证券	1,917,937.00	2.43
86	000719	中原传媒	1,895,695.00	2.40
87	600926	杭州银行	1,862,249.00	2.36
88	601058	赛轮轮胎	1,861,559.00	2.36
89	601607	上海医药	1,860,982.00	2.36
90	002841	视源股份	1,851,785.00	2.35
91	600466	蓝光发展	1,834,548.20	2.33
92	002798	帝欧家居	1,829,608.12	2.32
93	002832	比音勒芬	1,823,532.22	2.31
94	000739	普洛药业	1,805,651.00	2.29
95	600873	梅花生物	1,799,788.00	2.28
96	603355	莱克电气	1,782,282.80	2.26
97	600557	康缘药业	1,779,570.00	2.26
98	600704	物产中大	1,778,722.00	2.26

99	601021	春秋航空	1,776,475.04	2.25
100	002425	凯撒文化	1,752,902.00	2.22
101	000100	TCL 集团	1,722,817.00	2.18
102	600271	航天信息	1,708,957.00	2.17
103	000921	海信家电	1,707,140.00	2.16
104	000521	长虹美菱	1,682,877.00	2.13
105	002555	三七互娱	1,670,080.00	2.12
106	603986	兆易创新	1,667,977.00	2.11
107	000810	创维数字	1,590,133.00	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	601288	农业银行	8,046,953.00	10.20
2	000338	潍柴动力	6,646,458.30	8.43
3	601328	交通银行	6,189,359.46	7.85
4	600031	三一重工	6,023,255.78	7.64
5	601668	中国建筑	5,540,242.00	7.02
6	300003	乐普医疗	5,362,573.50	6.80
7	601818	光大银行	4,936,254.00	6.26
8	600887	伊利股份	4,711,163.39	5.97
9	601939	建设银行	4,690,021.00	5.95
10	600606	绿地控股	4,622,312.95	5.86
11	600999	招商证券	4,610,799.81	5.85
12	000596	古井贡酒	4,539,680.00	5.76
13	601336	新华保险	4,396,676.03	5.57
14	601688	华泰证券	4,338,978.00	5.50
15	601998	中信银行	4,327,870.34	5.49
16	601117	中国化学	4,251,154.00	5.39
17	002415	海康威视	4,222,749.35	5.35
18	000568	泸州老窖	4,111,680.00	5.21
19	000157	中联重科	4,108,265.00	5.21
20	601211	国泰君安	4,043,313.00	5.13
21	603288	海天味业	3,694,017.00	4.68
22	601607	上海医药	3,468,286.91	4.40
23	000425	徐工机械	3,348,027.00	4.24
24	601877	正泰电器	3,336,123.33	4.23

25	601229	上海银行	3,222,517.80	4.09
26	603444	吉比特	3,203,769.00	4.06
27	600390	五矿资本	3,202,022.98	4.06
28	600373	中文传媒	3,113,683.14	3.95
29	600351	亚宝药业	3,104,114.00	3.94
30	600048	保利地产	3,061,328.53	3.88
31	000963	华东医药	3,060,968.13	3.88
32	600637	东方明珠	3,060,039.65	3.88
33	002146	荣盛发展	3,054,070.38	3.87
34	601881	中国银河	3,051,705.00	3.87
35	002065	东华软件	2,993,495.00	3.80
36	601988	中国银行	2,961,364.00	3.75
37	002674	兴业科技	2,953,391.48	3.74
38	601788	光大证券	2,952,404.00	3.74
39	600566	济川药业	2,937,304.35	3.72
40	000063	中兴通讯	2,882,071.00	3.65
41	601169	北京银行	2,853,464.08	3.62
42	601377	兴业证券	2,839,987.28	3.60
43	000895	双汇发展	2,816,173.82	3.57
44	002352	顺丰控股	2,738,062.00	3.47
45	603368	柳药股份	2,707,018.00	3.43
46	600958	东方证券	2,659,577.00	3.37
47	600170	上海建工	2,547,857.00	3.23
48	300122	智飞生物	2,539,326.00	3.22
49	600873	梅花生物	2,530,512.70	3.21
50	600837	海通证券	2,476,297.00	3.14
51	600036	招商银行	2,469,019.62	3.13
52	601601	中国太保	2,446,712.00	3.10
53	600339	中油工程	2,403,807.00	3.05
54	000709	河钢股份	2,352,970.00	2.98
55	600143	金发科技	2,344,397.00	2.97
56	600588	用友网络	2,344,285.00	2.97
57	002271	东方雨虹	2,327,129.00	2.95
58	601166	兴业银行	2,317,937.10	2.94
59	600886	国投电力	2,273,181.00	2.88
60	000858	五粮液	2,254,297.00	2.86
61	002475	立讯精密	2,238,957.00	2.84
62	603968	醋化股份	2,217,098.19	2.81

63	601009	南京银行	2,200,864.00	2.79
64	601888	中国国旅	2,178,281.00	2.76
65	002111	威海广泰	2,165,221.00	2.75
66	601628	中国人寿	2,140,899.00	2.71
67	601012	隆基股份	2,138,705.24	2.71
68	600383	金地集团	2,109,475.00	2.67
69	000630	铜陵有色	2,085,442.00	2.64
70	000739	普洛药业	2,060,460.00	2.61
71	002841	视源股份	2,051,345.00	2.60
72	000100	TCL 集团	2,030,946.00	2.57
73	688111	金山办公	2,030,705.92	2.57
74	601369	陕鼓动力	2,000,007.02	2.54
75	600028	中国石化	1,956,838.30	2.48
76	000423	东阿阿胶	1,949,209.59	2.47
77	300130	新国都	1,943,071.00	2.46
78	002555	三七互娱	1,931,923.00	2.45
79	600757	长江传媒	1,913,706.00	2.43
80	600660	福耀玻璃	1,884,408.00	2.39
81	600909	华安证券	1,874,845.00	2.38
82	600704	物产中大	1,874,149.00	2.38
83	002714	牧原股份	1,866,543.00	2.37
84	600809	山西汾酒	1,851,361.00	2.35
85	002425	凯撒文化	1,850,977.00	2.35
86	002236	大华股份	1,826,534.00	2.32
87	000719	中原传媒	1,798,539.00	2.28
88	002081	金螳螂	1,792,309.00	2.27
89	002304	洋河股份	1,786,656.00	2.27
90	000810	创维数字	1,755,426.53	2.23
91	600977	中国电影	1,751,427.00	2.22
92	002737	葵花药业	1,748,550.00	2.22
93	603355	莱克电气	1,737,867.20	2.20
94	603886	元祖股份	1,732,775.00	2.20
95	000039	中集集团	1,732,438.40	2.20
96	600557	康缘药业	1,726,391.00	2.19
97	600519	贵州茅台	1,700,993.00	2.16
98	002832	比音勒芬	1,688,248.00	2.14
99	002601	龙麟佰利	1,687,273.00	2.14
100	300498	温氏股份	1,684,509.00	2.14

101	601006	大秦铁路	1,667,845.33	2.11
102	002353	杰瑞股份	1,617,992.00	2.05
103	000521	长虹美菱	1,615,754.00	2.05

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	502,937,782.27
卖出股票收入（成交）总额	484,349,758.67

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,531,900.00	4.16
	其中：政策性金融债	5,531,900.00	4.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	77,467.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,609,367.00	4.21

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开1704	55,000	5,531,900.00	4.16
2	128080	顺丰转债	650	77,467.00	0.06

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	30,306.87

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	155,064.61
5	应收申购款	11,910.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,282.02

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	3,614	19,171.35	7,538,263.17	10.88%	61,746,986.92	89.12%
长信量化多策略股票 C	15	2,495,491.79	37,077,551.00	99.05%	354,825.81	0.95%
合计	3,629	29,406.90	44,615,814.17	41.81%	62,101,812.73	58.19%

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	13,039.22	0.01%
	长信量化多策略股票 C	0.00	0.00%
	合计	13,039.22	0.01%

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 研究部门负责人持有本开放式基金	长信量化多策略股票 A	0
	长信量化多策略股票 C	0
	合计	0
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	0
	长信量化多策略股票 C	0
	合计	0

§ 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	85,050,421.13	216,308.16
本报告期基金总申购份额	52,035,091.23	38,144,118.71
减：本报告期基金总赎回份额	67,800,262.27	928,050.06
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	69,285,250.09	37,432,376.81

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2019 年 3 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在指定信息披露媒体发布相应公告。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给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 30,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 3 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国信证券	3	562,051,679.26	57.32%	298,615.18	47.30%	-
西南证券	1	367,659,244.14	37.50%	305,637.13	48.42%	-
安信证券	2	50,824,699.83	5.18%	27,003.11	4.28%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
申银万国（已退租）	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
西南证券	3,013,915.00	54.55%	-	-	-	-
安信证券	2,510,872.00	45.45%	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申银万国(已 退租)	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2019 年 1 月 1 日
2	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)费及转换业务的申购补差费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2019 年 1 月 10 日
3	长信量化多策略股票型证券投资基金 2018 年 第 4 季度报告	中证报、公司网 站	2019 年 1 月 19 日
4	长信量化多策略股票型证券投资基金更新的 招募说明书(2019 年第【1】号)及摘要(仅 摘要见报)	中证报、公司网 站	2019 年 2 月 27 日
5	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、公司网 站	2019 年 3 月 1 日
6	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司 网站	2019 年 3 月 2 日
7	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、公司网 站	2019 年 3 月 28 日
8	长信量化多策略股票型证券投资基金 2018 年 年度报告及摘要(仅摘要见报)	中证报、公司网 站	2019 年 3 月 29 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、证券 日报、公司网站	2019 年 3 月 30 日
10	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、公司网 站	2019 年 4 月 8 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开 放式基金在上海联泰基金销售有限公司开通 转换、定期定额投资业务及参加申购(含定 额申购)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	2019 年 4 月 15 日
12	长信量化多策略股票型证券投资基金 2019 年 第 1 季度报告	中证报、公司网 站	2019 年 4 月 22 日

13	长信基金管理有限责任公司关于增加华鑫证券有限责任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	2019年4月26日
14	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、公司网站	2019年5月7日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行基金通平台申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月14日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月22日
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年6月22日
18	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、公司网站	2019年6月26日
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银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、公司网站	2019年6月27日
20	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2019年6月30日资产净值的公告	公司网站	2019年7月1日
21	长信量化多策略股票型证券投资基金2019年第2季度报告	中证报、公司网站	2019年7月18日
22	长信量化多策略股票型证券投资基金2019年半年度报告及摘要（仅摘要见报）	中证报、公司网站	2019年8月27日
23	长信量化多策略股票型证券投资基金更新的招募说明书（2019年第【2】号）及摘要（仅摘要见报）	中证报、公司网站	2019年8月27日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019年9月25日
25	长信量化多策略股票型证券投资基金2019年第3季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2019年10月23日
26	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2019年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年10月23日
27	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金参加“长金通”网上直销平台及	上证报、中证报、证券时报、证券	2019年12月26日

	直销柜台基金转换业务的公告	日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	
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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 30 日
29	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等活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 30 日
30	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金相关法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
31	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及摘要的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
32	长信量化多策略股票型证券投资基金更新的招募说明书及摘要（仅摘要见报）	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
33	长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
34	长信量化多策略股票型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 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	2019 年 8 月 28 日至 2019 年 12 月 25 日	0.00	44,238,263.17	36,700,000.00	7,538,263.17	7.06%
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

2020年4月27日