

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证
券投资基金
2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 3 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信电子信息量化混合
场内简称	信息量化
基金主代码	519929
交易代码	519929
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	539,014,046.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，并精选电子信息行业的优质企业进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金结合基金管理人量化团队多年定量研究与投资的经验，充分挖掘并不断扩充对市场、对组合构建产生影响的各种因子，并利用定量模式，甄别不同股票未来获取超额收益的可能性，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在控制组合风险的基础上，力求获得超越基准的投资回报。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严</p>

	格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	陆志俊
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼, 上海市仙霞路 18 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 7 月 27 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-148,537,992.61	-115,283,344.68	3,415,392.24
本期利润	-141,949,949.83	-82,419,369.62	-51,478,275.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2558	-0.1040	-0.0567
本期基金份额净值增长率	-30.22%	-11.65%	-5.60%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4176	-0.1662	-0.0555
期末基金资产净值	313,944,113.15	465,500,431.01	844,413,943.05
期末基金份额净值	0.582	0.834	0.944

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。

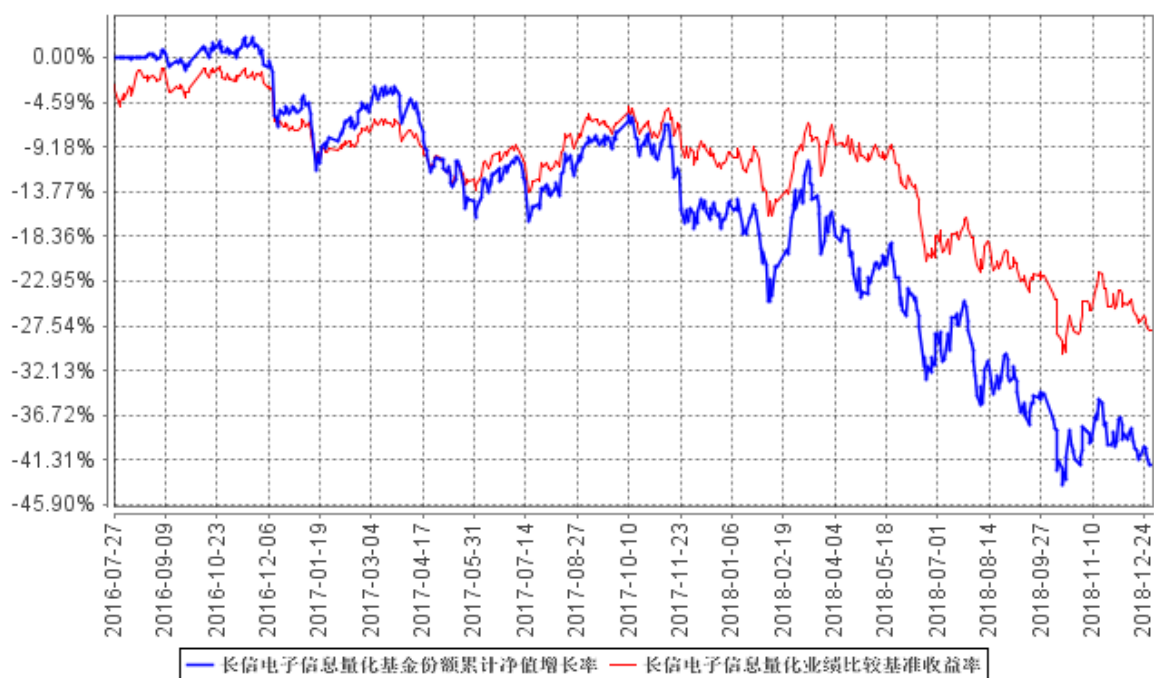
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.01%	2.01%	-7.25%	1.27%	-3.76%	0.74%
过去六个月	-18.72%	1.89%	-11.93%	1.13%	-6.79%	0.76%
过去一年	-30.22%	1.83%	-19.33%	1.11%	-10.89%	0.72%
自基金合同生效起至今	-41.80%	1.37%	-28.00%	0.87%	-13.80%	0.50%

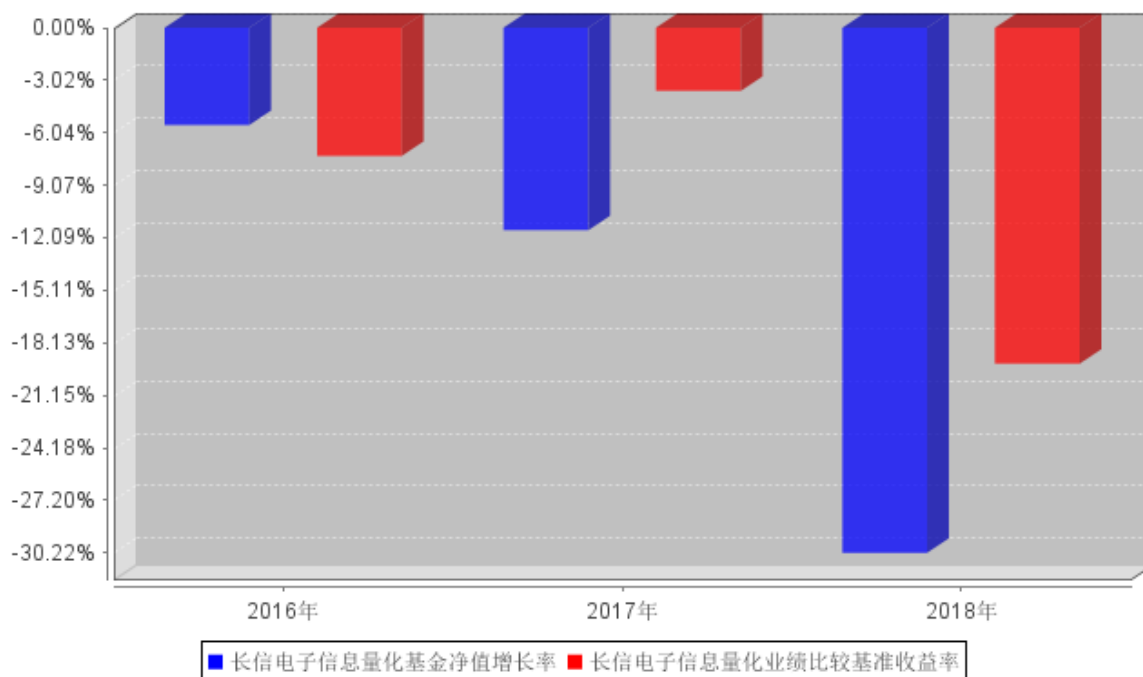
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2016 年 7 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金管理人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约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为 2016 年 7 月 27 日，2016 年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 7 月 27 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 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 64 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、长信量化价值精选混合型证券投资基金、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）。

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、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资	2016年7月27日	-	8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和长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部总监兼量化研究部总监、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、

	资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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化研究部总监、投资决策委员会执行委员			长信量化中小盘股票型证券投资基金、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、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	---

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

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

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

2018 年中国经济持续下行，宏观环境内外交困，虽然银行间市场资金宽裕，但实体产业基本面并未好转，造成全年股票市场下跌，而债券市场上涨。在第一季度中，金融板块和周期板块先涨后跌，计算机和电子等科技板块先跌后涨，呈现背离走势。但随后三个季度中，市场呈现整体性下跌走势，医药和白酒板块内的绩优白马股更是在 10 月份大幅下行，市场情绪惨淡。全年来看，大部分行业跌幅都在 25% 至 35% 之间，仅银行、餐饮旅游、石化、食品饮料等板块跌幅相对较小，同时行业之间走势高度趋同，造成了行业配置的空间受压。整体上来看，各大宽基指数表现差异较小，上证 50 跌 20%，上证综指跌 25%，沪深 300 跌 25%，创业板指跌 30%，中证 500 跌 33%。

2018 年 TMT 板块受制于中美贸易战、需求下滑取消等因素，整体表现欠佳，电子元器件、半导体指数全年下跌超过市场均值，但是仅计算机行业的表现相对优秀。

2018 年市场偏好保守类的投资策略，在经济增速下行、国际局势不明朗、企业盈利确定性降低和成长性走弱的情况下，盈利估值类和成长类策略表现不佳，市场风险偏好明显降低，投资者寻求更高的安全边际，诸如高股息策略表现相对更好，而量价类的策略在年内呈现较高波动性，策略的性价比大不如前。经历了 2018 年，在继续坚持行业均衡、风格分散原则下，我们将进一步改进量化模型，增强模型对极端行情的适应能力和应变能力，以保证基金风格稳定和收益稳健性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.582 元，份额累计净值为 0.582 元，本报告期内基金净值增长率-30.22%，同期业绩基准收益率为-19.33%。

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 2019 年，宏观环境依旧艰难，经济增速难有起色，但随着货币政策逐步宽松、减税降费政策逐步实施，广义流动性和资本回报率将得到改善，企业的基本面将逐步好转。同时政府投资和民间投资的企稳反弹也给中国经济和资本市场注入新的动力。放眼国际，虽然中美贸易冲突存

在不确定性，但全球经济下滑的局面也使得各国政府谨慎看待紧缩型政策，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环境将更加多元化和专业化，市场风格将更加分散，不同的投资策略或都将有各自的机会。2018 年指数全年运行至历史低位，估值水平已经蕴含较高安全边际，且行业中观表现也在不同程度的企稳转暖，具体到 TMT 领域，长期宏观政策支持与产业经营压力变大的情况短期不会改变，产业内的马太效应会继续提升龙头公司的竞争优势，同时稳健的业务模式和企业管理会被给予更合理的估值为此我们对 A 股保持谨慎乐观，届时我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。

4.6 管理人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。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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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

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，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基

金默认的收益分配方式是现金分红。

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018 年度，基金托管人在长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018 年度，长信基金管理有限责任公司在长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018 年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

本报告期末基金 2018 年度财务报告经德勤华永会计师事务所(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(德师报(审)字(19)第 P00148 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：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	22,192,843.42	23,425,649.60
结算备付金	2,107,085.76	2,934,191.73
存出保证金	103,213.45	257,602.50
交易性金融资产	291,711,226.94	407,866,709.34
其中：股票投资	289,138,353.14	404,277,155.94
基金投资	-	-
债券投资	2,572,873.80	3,589,553.40
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	567,381.78	35,213,986.66
应收利息	7,847.80	-5,775.03
应收股利	-	-
应收申购款	13,200.07	18,603.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	316,702,799.22	469,710,968.67
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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	1,304,872.12	1,836,041.77
应付赎回款	226,995.88	471,593.94
应付管理人报酬	415,305.69	605,768.50
应付托管费	69,217.61	100,961.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	483,200.25	925,328.32
应交税费	70.13	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	259,024.39	270,843.72
负债合计	2,758,686.07	4,210,537.66
所有者权益：		
实收基金	539,014,046.74	558,292,769.23
未分配利润	-225,069,933.59	-92,792,338.22
所有者权益合计	313,944,113.15	465,500,431.01
负债和所有者权益总计	316,702,799.22	469,710,968.67

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.582 元，基金份额总额 539,014,046.74 份。

7.2 利润表

会计主体：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-130,994,462.63	-64,204,175.03
1. 利息收入	380,065.93	829,867.15
其中：存款利息收入	272,971.48	779,070.20
债券利息收入	90,467.06	914.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	16,627.39	49,882.20
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-138,058,376.28	-99,527,889.28
其中：股票投资收益	-141,505,418.05	-103,034,972.09
基金投资收益	-	-
债券投资收益	442,937.71	-
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	3,004,104.06	3,507,082.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,588,042.78	32,863,975.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	95,804.94	1,629,872.04
减：二、费用	10,955,487.20	18,215,194.59
1. 管理人报酬	6,000,647.97	10,734,511.10
2. 托管费	1,000,107.98	1,789,085.17
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	3,653,183.97	5,373,933.40
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	27.86	-
7. 其他费用	301,519.42	317,664.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-141,949,949.83	-82,419,369.62
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-141,949,949.83	-82,419,369.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	558,292,769.23	-92,792,338.22	465,500,431.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-141,949,949.83	-141,949,949.83
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）	-19,278,722.49	9,672,354.46	-9,606,368.03
其中：1. 基金申购款	115,036,441.39	-20,174,050.36	94,862,391.03
2. 基金赎回款	-134,315,163.88	29,846,404.82	-104,468,759.06
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）	539,014,046.74	-225,069,933.59	313,944,113.15
项目	上年度可比期间 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）	894,058,293.77	-49,644,350.72	844,413,943.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-82,419,369.62	-82,419,369.62
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）	-335,765,524.54	39,271,382.12	-296,494,142.42
其中：1. 基金申购款	329,215,786.75	-39,870,508.07	289,345,278.68
2. 基金赎回款	-664,981,311.29	79,141,890.19	-585,839,421.10
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）	558,292,769.23	-92,792,338.22	465,500,431.01

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

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金(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》、《长信电子信息量化灵活配置混合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[2016]1196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891,999,358.96份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于2016年7月27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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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《长信电子信息行业量化灵活配置混合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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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、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:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;投资于电子信息行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。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为:中证 TMT 产业主题指数收益率 \times 60%+中证综合债指数收益率 \times 40%。

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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、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
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东(股权转让前的股东)
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
武汉钢铁有限公司	基金管理人的股东(股权转让后的股东)

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，并获中国证券监督管理委员会《关于核准长信基金管理有限责任公司变更股权的批复》(证监许可[2018]1905号)，长信基金管理有限责任公司原股东武汉钢铁股份有限公司将其持有的长信基金管理有限责任公司 15.15%的股权全部转让给武汉钢铁有限公司。长信基金管理有限责任公司 2018 年 12 月 21 日已就股东变更事宜发布公告，股东变更为长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁有限公司、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)。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
长江证券	242,627,968.56	7.99%	1,211,640,867.82	29.59%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	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 成交总额的比 例
长江证券	376,029.10	2.35%	-	-

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未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长江证券	205,092.30	10.95%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
长江证券	1,019,269.47	35.47%	112,025.01	12.11%

注：1、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。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用长江证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从长江证券获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,000,647.97	10,734,511.10

其中：支付销售机构的客户维护费	2,583,076.31	4,721,212.67
-----------------	--------------	--------------

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,000,107.98	1,789,085.17

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	22,192,843.42	249,074.26	23,425,649.60	647,229.42

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，于 2018 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 2,107,085.76 元(2017 年 12 月 31 日：相关余额为人民币 2,934,191.73 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	新股锁定	13.77	10.97	17,576	242,021.52	192,808.72	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无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	289,138,353.14	91.30
	其中：股票	289,138,353.14	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,572,873.80	0.81
	其中：债券	2,572,873.80	0.81
	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	24,299,929.18	7.67
8	其他各项资产	691,643.10	0.22
9	合计	316,702,799.22	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	156,874,819.84	49.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,008,243.40	38.23
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	-	-

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	12,255,289.90	3.90
S	综合	-	-
	合计	289,138,353.14	92.10

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	002396	星网锐捷	716,250	12,333,825.00	3.93
2	600373	中文传媒	941,990	12,255,289.90	3.90
3	000049	德赛电池	382,708	10,976,065.44	3.50
4	603444	吉比特	74,120	10,969,760.00	3.49
5	300271	华宇软件	700,000	10,507,000.00	3.35
6	002815	崇达技术	705,547	10,308,041.67	3.28
7	000948	南天信息	1,055,492	10,069,393.68	3.21
8	002463	沪电股份	1,383,845	9,922,168.65	3.16
9	300458	全志科技	489,900	9,798,000.00	3.12
10	300170	汉得信息	997,388	9,754,454.64	3.11

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300219	鸿利智汇	41,891,008.32	9.00
2	300327	中颖电子	35,762,654.92	7.68
3	603660	苏州科达	34,459,737.55	7.40
4	300207	欣旺达	33,818,860.14	7.27
5	002139	拓邦股份	30,396,411.67	6.53

6	002587	奥拓电子	30,130,270.70	6.47
7	002402	和而泰	27,718,219.53	5.95
8	300476	胜宏科技	27,037,999.68	5.81
9	300170	汉得信息	26,427,576.24	5.68
10	600845	宝信软件	25,599,509.55	5.50
11	002635	安洁科技	24,103,331.73	5.18
12	300365	恒华科技	23,446,843.20	5.04
13	002236	大华股份	23,027,331.22	4.95
14	300383	光环新网	21,672,250.96	4.66
15	002475	立讯精密	21,551,622.79	4.63
16	002376	新北洋	21,243,253.75	4.56
17	300433	蓝思科技	21,108,431.29	4.53
18	002415	海康威视	20,081,487.34	4.31
19	300571	平治信息	19,953,542.00	4.29
20	600667	太极实业	19,878,587.00	4.27
21	300323	华灿光电	19,647,556.16	4.22
22	603025	大豪科技	19,430,540.63	4.17
23	300115	长盈精密	19,412,253.01	4.17
24	300088	长信科技	19,023,837.44	4.09
25	002624	完美世界	18,884,612.96	4.06
26	002518	科士达	18,835,589.10	4.05
27	002056	横店东磁	18,458,119.21	3.97
28	002745	木林森	18,395,078.56	3.95
29	002371	北方华创	17,908,466.55	3.85
30	002463	沪电股份	17,549,983.90	3.77
31	002341	新纶科技	17,459,273.00	3.75
32	600563	法拉电子	17,443,084.51	3.75
33	600183	生益科技	16,917,721.87	3.63
34	002241	歌尔股份	16,799,682.00	3.61
35	002217	合力泰	16,551,992.60	3.56
36	002396	星网锐捷	16,436,233.00	3.53
37	300523	辰安科技	16,033,060.24	3.44
38	002491	通鼎互联	14,860,858.00	3.19
39	300251	光线传媒	14,839,088.00	3.19
40	300545	联得装备	14,798,416.93	3.18
41	002815	崇达技术	14,558,794.02	3.13

42	600588	用友网络	14,192,293.70	3.05
43	300395	菲利华	14,187,676.55	3.05
44	000049	德赛电池	14,092,809.28	3.03
45	300271	华宇软件	13,774,485.00	2.96
46	600703	三安光电	13,431,350.00	2.89
47	002138	顺络电子	13,358,370.00	2.87
48	300226	上海钢联	13,161,864.84	2.83
49	300458	全志科技	13,066,308.00	2.81
50	603228	景旺电子	13,059,128.75	2.81
51	000636	风华高科	12,900,826.00	2.77
52	300212	易华录	12,898,194.00	2.77
53	600570	恒生电子	12,738,291.00	2.74
54	600446	金证股份	12,589,273.00	2.70
55	002555	三七互娱	12,093,631.36	2.60
56	002174	游族网络	11,925,861.52	2.56
57	000555	神州信息	11,717,515.94	2.52
58	600050	中国联通	11,498,245.00	2.47
59	002456	欧菲科技	11,359,135.84	2.44
60	002195	二三四五	11,308,261.20	2.43
61	300438	鹏辉能源	11,285,477.04	2.42
62	603678	火炬电子	11,239,645.58	2.41
63	300113	顺网科技	10,962,799.00	2.36
64	300130	新国都	10,734,916.82	2.31
65	600373	中文传媒	10,717,526.47	2.30
66	002777	久远银海	10,569,862.00	2.27
67	300136	信维通信	10,519,955.94	2.26
68	300047	天源迪科	10,519,157.00	2.26
69	002027	分众传媒	10,311,027.13	2.22
70	300389	艾比森	10,300,754.32	2.21
71	300232	洲明科技	10,093,004.62	2.17
72	002439	启明星辰	10,061,300.00	2.16
73	000948	南天信息	9,880,348.84	2.12
74	300038	数知科技	9,777,040.00	2.10
75	002383	合众思壮	9,702,025.78	2.08
76	600487	亨通光电	9,358,820.98	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	300365	恒华科技	41,481,329.76	8.91
2	002236	大华股份	36,992,111.65	7.95
3	300219	鸿利智汇	35,270,359.65	7.58
4	600183	生益科技	31,986,179.66	6.87
5	002518	科士达	30,657,255.94	6.59
6	300115	长盈精密	30,603,110.68	6.57
7	603660	苏州科达	27,981,597.86	6.01
8	600563	法拉电子	27,937,994.18	6.00
9	002139	拓邦股份	26,769,138.75	5.75
10	300327	中颖电子	26,629,029.73	5.72
11	002415	海康威视	26,283,004.39	5.65
12	300323	华灿光电	25,451,328.82	5.47
13	002624	完美世界	25,398,821.70	5.46
14	600845	宝信软件	24,643,801.01	5.29
15	002027	分众传媒	24,212,339.01	5.20
16	002635	安洁科技	23,095,832.00	4.96
17	300207	欣旺达	21,291,178.08	4.57
18	603025	大豪科技	21,150,400.21	4.54
19	600667	太极实业	20,826,005.76	4.47
20	300476	胜宏科技	20,776,063.03	4.46
21	300383	光环新网	20,381,457.70	4.38
22	002376	新北洋	20,232,620.57	4.35
23	300296	利亚德	20,180,899.72	4.34
24	002008	大族激光	19,808,878.32	4.26
25	002195	二三四五	19,405,110.00	4.17
26	300433	蓝思科技	19,394,859.96	4.17
27	300571	平治信息	18,923,997.64	4.07
28	002402	和而泰	18,323,312.33	3.94
29	002241	歌尔股份	18,034,710.56	3.87
30	300182	捷成股份	18,022,446.15	3.87
31	002587	奥拓电子	17,991,929.07	3.87
32	002745	木林森	17,234,024.50	3.70
33	600703	三安光电	17,122,148.00	3.68
34	002056	横店东磁	17,070,859.38	3.67

35	300088	长信科技	16,655,217.76	3.58
36	000413	东旭光电	16,516,500.00	3.55
37	000050	深天马A	16,181,820.77	3.48
38	002449	国星光电	15,736,970.38	3.38
39	300438	鹏辉能源	15,711,301.96	3.38
40	002456	欧菲科技	15,183,051.83	3.26
41	002217	合力泰	14,508,476.40	3.12
42	600588	用友网络	14,455,076.32	3.11
43	000636	风华高科	14,350,976.18	3.08
44	002463	沪电股份	14,091,503.43	3.03
45	002341	新纶科技	14,065,418.57	3.02
46	300170	汉得信息	13,407,270.50	2.88
47	300395	菲利华	13,303,186.86	2.86
48	300251	光线传媒	13,271,260.97	2.85
49	002475	立讯精密	13,208,060.00	2.84
50	000049	德赛电池	12,789,118.98	2.75
51	002491	通鼎互联	12,671,048.00	2.72
52	600271	航天信息	12,597,837.70	2.71
53	600487	亨通光电	12,447,383.57	2.67
54	300226	上海钢联	12,343,268.26	2.65
55	300545	联得装备	12,155,394.10	2.61
56	300523	辰安科技	12,073,673.88	2.59
57	600050	中国联通	11,950,267.00	2.57
58	603228	景旺电子	11,740,230.84	2.52
59	002555	三七互娱	11,638,274.12	2.50
60	000555	神州信息	11,478,130.40	2.47
61	300232	洲明科技	10,939,026.83	2.35
62	002777	久远银海	10,910,695.00	2.34
63	600525	长园集团	10,647,219.90	2.29
64	300038	数知科技	10,606,199.70	2.28
65	300113	顺网科技	10,427,430.28	2.24
66	603678	火炬电子	10,401,242.25	2.23
67	300389	艾比森	9,635,441.69	2.07
68	002383	合众思壮	9,393,776.72	2.02
69	300083	劲胜智能	9,384,800.00	2.02
70	000725	京东方A	9,379,297.00	2.01
71	002396	星网锐捷	9,359,974.00	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,530,849,456.63
卖出股票收入（成交）总额	1,511,292,563.76

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	2,572,873.80	0.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,572,873.80	0.82

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	110040	生益转债	16,420	1,690,603.20	0.54
2	128035	大族转债	8,870	866,244.20	0.28
3	128018	时达转债	184	16,026.40	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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	103,213.45
2	应收证券清算款	567,381.78
3	应收股利	-
4	应收利息	7,847.80
5	应收申购款	13,200.07
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	691,643.10

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110040	生益转债	1,690,603.20	0.54
2	128035	大族转债	866,244.20	0.28
3	128018	时达转债	16,026.40	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,113	131,051.31	94,897,983.39	17.61%	444,116,063.35	82.39%

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	0.00	0.00%

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（2016年7月27日）基金份额总额	891,999,358.96
本报告期期初基金份额总额	558,292,769.23
本报告期期间基金总申购份额	115,036,441.39
减:本报告期期间基金总赎回份额	134,315,163.88
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	539,014,046.74

§ 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 2018 年 8 月 28 日起，本基金管理人增聘安昀先生为副总经理。

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的《基金行业高级管理人员变更公告》。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 50,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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			
东北证券	1	819,071,579.57	26.98%	435,174.11	23.24%	-
国泰君安	1	621,085,611.97	20.46%	329,986.43	17.62%	-
安信证券	1	420,051,970.53	13.83%	223,176.94	11.92%	-
长江证券	2	242,627,968.56	7.99%	205,092.30	10.95%	-
兴业证券	2	228,873,849.17	7.54%	190,260.80	10.16%	-
平安证券	1	222,556,058.34	7.33%	118,246.24	6.32%	-
中泰证券	1	135,951,912.09	4.48%	113,017.90	6.04%	-
华泰证券	2	133,771,852.49	4.41%	71,070.91	3.80%	-
华创证券	1	115,962,760.60	3.82%	107,997.19	5.77%	-
中银国际证 券	1	51,190,456.63	1.69%	42,554.51	2.27%	-
光大证券	1	39,507,679.36	1.30%	32,843.37	1.75%	-
金元证券	1	5,612,108.00	0.18%	2,981.73	0.16%	-
广发证券(已 退租)	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

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
东北证券	5,002,531.03	31.20%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	376,029.10	2.35%	-	-	-	-
兴业证券	10,653,362.21	66.45%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券(已 退租)	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化如下：

新增租用开源证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

- 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%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

2019 年 3 月 29 日