

长信量化中小盘股票型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等。复核结果表明，报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金过往的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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,469,001,719.64	84.06
	其中:股票	3,469,001,719.64	84.06
2	基金投资	-	-
	其中:国债	-	-
	货币市场基金	-	-
	债券	-	-
	贵金属	-	-
	货币市场基金	-	-
3	贵金属投资	20,000,100.00	0.49
4	银行存款	609,089,201.65	14.64
5	其他资产	8,517,143.20	0.21
6	合计	4,097,238,214.00	100.00

基金简称	长信量化中小盘股票
场内简称	CXLF中
基金主代码	519975
交易代码	519975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-07-01
报告期末基金资产总额	4,097,238,214.00

注:本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业	121,000,216.26	3.02	
B 采矿业	-	-	
C 制造业	2,006,421,063.73	49.02	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	126,850,066.00	3.14	
E 建筑业	62,615,180.26	1.59	
F 银行业	93,031,070.26	2.33	
G 交通运输、仓储和邮政业	131,590.10	0.00	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	193,104,751.60	4.79	
J 金融业	37,151.00	0.00	
K 制造业	-	-	
L 批发和零售业	-	-	
M 科学、技术服务业	20,090.00	0.00	
N 水利、环境和公共设施管理业	47,662.20	0.00	
O 国防、军队管理	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生、社会保障和社会福利业	4,164.01	0.00	
R 综合	62,624,068.32	1.56	
S 合计	4,097,238,214.00	100.00	

注:本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-	-10,170,413.30
2.本期利润	-	-36,226,544.00
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.0080
4.期末基金资产净值	4,028,248,397.00	
5.期末基金份额净值	1.002	

注:1.本期已实现收益指收入包含利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额,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. 所属行业分类的前十名股票占基金资产净值比例(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等)。

3. 所属行业分类的前十名股票占基金资产净值比例(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等)。

4. 本期每万份基金单位收益:0.0021元。

5. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

6. 本期每万份基金单位净值:1.002。

7. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

8. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

9. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

10. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

11. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

12. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

13. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

14. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

15. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

16. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

17. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

18. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

19. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

20. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

21. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

22. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

23. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

24. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

25. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

26. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

27. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

28. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

29. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

30. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

31. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

32. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

33. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

34. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

35. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

36. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

37. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

38. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

39. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

40. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

41. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

42. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

43. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

44. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

45. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

46. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

47. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

48. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

49. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

50. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

51. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

52. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

53. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

54. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

55. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

56. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

57. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

58. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

59. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

60. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

61. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

62. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

63. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

64. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

65. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

66. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

67. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

68. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

69. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

70. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

71. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

72. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。

73. 本报告期无持有人数或基金资产净值低于0.01元的列示。