

长信中证500指数增强型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月17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,也不保证基金份额净值不代其未来表现。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。

本报告期自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	长信中证500指数增强型证券投资基金
基金代码	004946
交易代码	004946
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月31日
报告期末基金份额总额	315,202,169.40元

投资目标:本基金将跟踪中证500指数,通过严谨的投资策略力争实现超越中证500指数的投资目标,力争实现长期稳定的增值。本基金采用量化投资策略,通过量化模型对中证500指数的成分股进行筛选,并根据市场变化动态调整投资组合,力争实现超越中证500指数的投资目标。

投资策略:本基金采用量化投资策略,通过严谨的投资策略力争实现超越中证500指数的投资目标,力争实现长期稳定的增值。本基金采用量化投资策略,通过量化模型对中证500指数的成分股进行筛选,并根据市场变化动态调整投资组合,力争实现超越中证500指数的投资目标。

风险控制:本基金采用量化投资策略,通过严谨的投资策略力争实现超越中证500指数的投资目标,力争实现长期稳定的增值。本基金采用量化投资策略,通过量化模型对中证500指数的成分股进行筛选,并根据市场变化动态调整投资组合,力争实现超越中证500指数的投资目标。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年10月1日至2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-5,479,281.24
2.本期利润	-5,517,046.63
3.本期基金份额净值增长率	-0.0501%
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	-0.0811%

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,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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准收益率的差距②
过去三个月	-0.11%	-0.07%
过去六个月	-0.07%	-0.06%
过去一年	-0.05%	-0.08%

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

注:1、本基金基金合同生效日为2017年5月31日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年,图示日期为2017年5月31日至2017年12月31日。

2、本基金合同规定,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,本基金各投资比例符合基金合同约定;本基金自建仓期结束后,本基金各投资比例符合基金合同约定。

截至本报告期末,本基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	离任日期	证券从业年限	说明
魏欣	基金经理	2017年5月21日	-	10年	曾任中投证券,光大证券资产管理部,现任长信基金管理有限责任公司基金经理。2017年5月21日加入长信基金管理有限责任公司,担任长信中证500指数增强型证券投资基金基金经理。魏欣先生拥有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资理论功底,具备良好的风险控制能力。

注:1、基金经理离任日期以本基金成立之日为准;新基金经理上任日期以基金管理人公告为准。

2、本基金基金经理的任职时间从该基金经理进入证券行业相关工作经历开始计算。

4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本基金严格执行公平交易制度,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,并通过技术手段,确保技术公平交易制度的实施。同时,公司已通过对投资交易行为的监控,分析评估信息披露来加强对公平交易过程持续不断的监督。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,除完全按照有关指数成份比例进行投资的组合外,其余各投资组合未发生异常交易。所有异常交易行为均符合基金合同约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金严格执行公平交易制度,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,并通过技术手段,确保技术公平交易制度的实施。同时,公司已通过对投资交易行为的监控,分析评估信息披露来加强对公平交易过程持续不断的监督。

4.4 报告期内基金投资组合报告

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金严格执行公平交易制度,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,并通过技术手段,确保技术公平交易制度的实施。同时,公司已通过对投资交易行为的监控,分析评估信息披露来加强对公平交易过程持续不断的监督。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,除完全按照有关指数成份比例进行投资的组合外,其余各投资组合未发生异常交易。所有异常交易行为均符合基金合同约定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,121,204.00	0.36
B	采矿业	8,124,717.60	2.63
C	制造业	146,201,376.31	47.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,293,288.20	5.16
E	建筑业	3,789,224.60	1.22
F	批发和零售业	10,969,084.00	3.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,657,160.00	0.53
H	住宿和餐饮业	1,769,118.00	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,171,070.00	4.22
J	金融业	2,587,052.00	0.83
K	房地产业	14,776,316.00	4.72
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	1,362,709.00	0.44
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,985,816.00	2.57
S	综合	883,620.00	0.28
合计		200,480,684.71	64.41

5.2 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.3 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.4 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.5 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.6 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.7 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.8 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.9 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.10 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,070.00	0.62
J	金融业	886,100.00	0.28
K	房地产业	3,050,740.00	0.98
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	50,220.00	-
O	建筑业、房地产业、信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	4,617,360.00	1.46
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	883,620.00	0.28
合计		39,962,564.84	12.63

5.11 报告期末投资组合行业分布情况

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,054,100.00	0.40
C	制造业	22,896,000.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,053,420.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,271,870.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,977,070.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业</		