

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 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.....	46
7.8 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.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
11.1 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.....	54

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长信睿进混合	
基金主代码	519957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 6 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	57,752,313.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
下属分级基金场内简称:	睿进A	睿进C
下属分级基金的交易代码:	519957	519956
报告期末下属分级基金的份额总额	7,765,963.35 份	49,986,349.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
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>1) 行业配置策略 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>2) 个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</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</p>

	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。 4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严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	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	崔瑞娟
	联系电话	021-61009999	020-87555888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4007005566	95575
传真		021-61009800	020-87555129
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	广东省广州市天河区天河北路 183 至 187 号大都会广场 40 楼
邮政编码		200120	510620
法定代表人		成善栋	孙树明

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、上海证券报和证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼，广东省广州市天河区天河北路 183 至 187 号大都会广场 40 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-1,504,253.86	-9,444,545.98
本期利润	-173,280.09	-1,234,607.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0193	-0.0216
本期加权平均净值利润率	-2.06%	-2.36%
本期基金份额净值增长率	-2.23%	-2.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	-1,029,295.43	-7,488,209.08
期末可供分配基金份额利润	-0.1325	-0.1498
期末基金资产净值	7,144,493.67	45,004,079.72
期末基金份额净值	0.920	0.900
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-8.00%	-10.00%

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

长信睿进混合 A

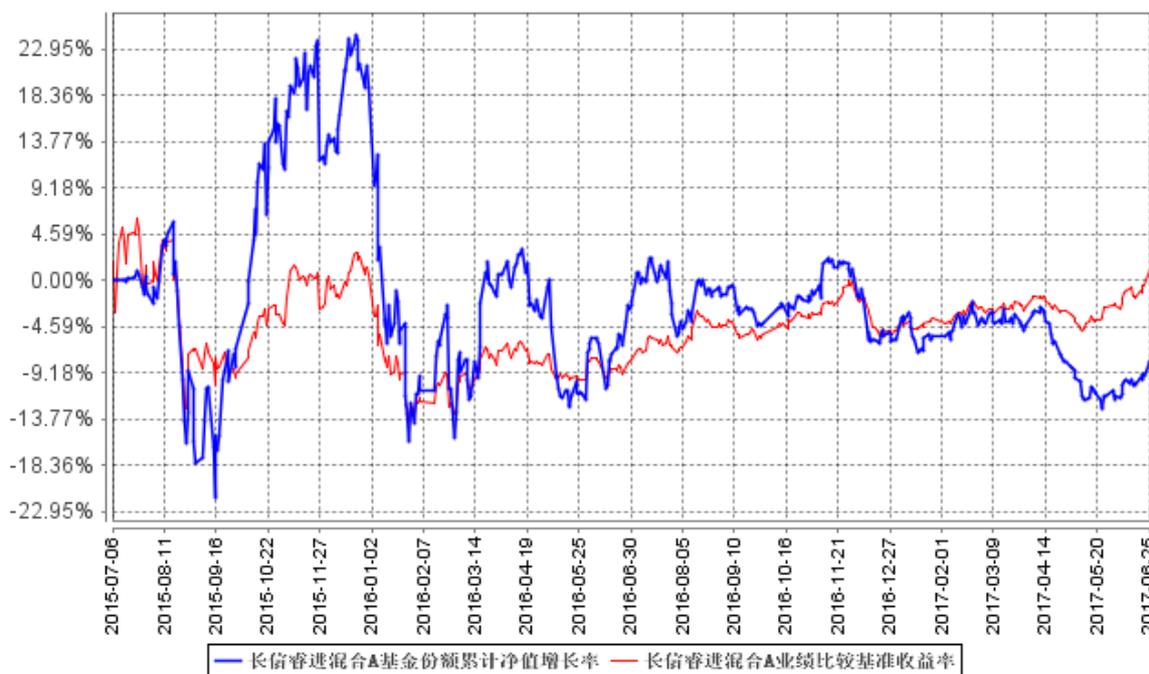
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.37%	0.51%	3.46%	0.40%	-0.09%	0.11%
过去三个月	-3.66%	0.62%	3.70%	0.38%	-7.36%	0.24%
过去六个月	-2.23%	0.67%	6.30%	0.35%	-8.53%	0.32%
过去一年	-5.64%	0.82%	9.67%	0.41%	-15.31%	0.41%

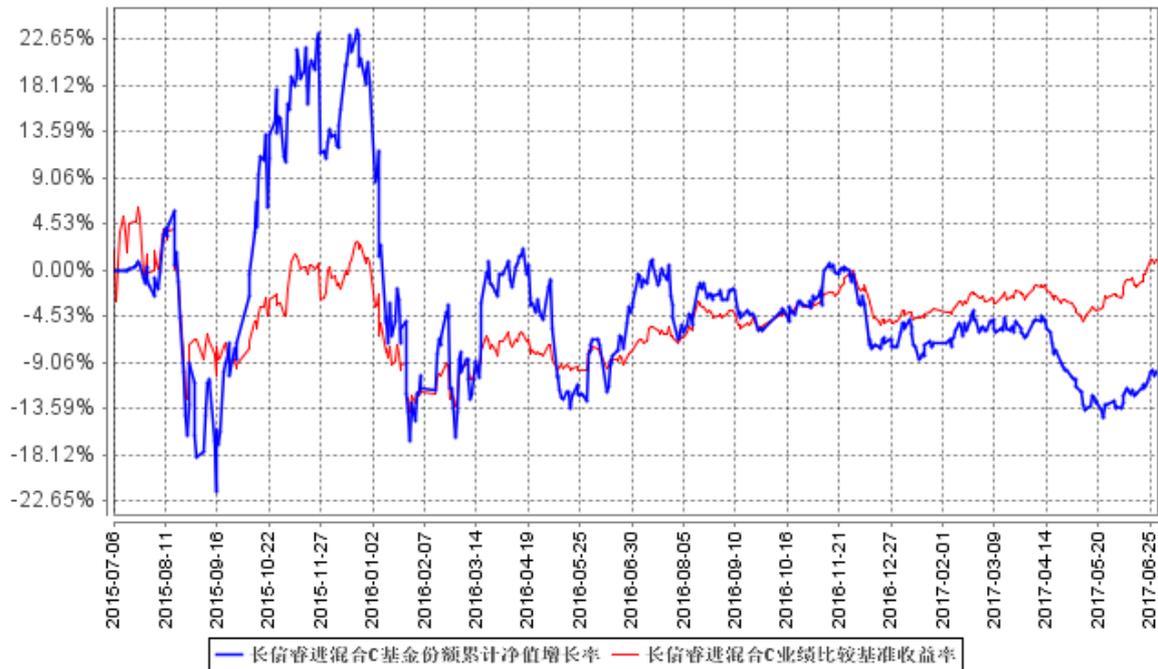
自基金合同生效起至今	-8.00%	1.96%	0.97%	1.00%	-8.97%	0.96%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

长信睿进混合 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
过去一个月	3.33%	0.49%	3.46%	0.40%	-0.13%	0.09%
过去三个月	-3.85%	0.62%	3.70%	0.38%	-7.55%	0.24%
过去六个月	-2.70%	0.66%	6.30%	0.35%	-9.00%	0.31%
过去一年	-6.54%	0.82%	9.67%	0.41%	-16.21%	0.41%
自基金合同生效起至今	-10.00%	1.97%	0.97%	1.00%	-10.97%	0.97%

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 2015 年 7 月 6 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立，注册资本 1.65 亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为 4.54%。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券

投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）。

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		
邓虎	长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理、FOF 投资部总监。	2017 年 3 月 18 日	-	7 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2015 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司 FOF 投资部总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。
谈洁颖	曾任本基金的基金经理	2015 年 7 月 6 日	2017 年 3 月 29 日	13 年	曾任本基金的基金经理

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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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。

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

前期我们对市场的观点是，在低波动率和低成交量的市场中，未来更有可能维持之前的趋势，也就是市场将维持偏震荡向上的格局。同时，在这种偏震荡向上的格局中，结构上、局部上形成赚钱效应，相对而言我们更看好已经经历过较长时间和较大幅度调整的中小盘股票。

回顾 2017 年上半年行情，上证 50 指数涨幅 11.50%，沪深 300 指数涨幅 10.78%，中证 500 指数涨幅-2.00%，中证 1000 指数涨幅-12.07%。市场表现出强烈的一九效应，大小盘风格之间的差异不仅没有收敛，反而是愈演愈烈，延续了 2016 年 4 季度以来的风格分化。上证 50 指数和中证 1000 指数差异超过 20%，历史上罕见。

本基金期间 A 级净值涨幅-2.23%，C 级净值涨幅-2.70%，涨幅弱于本基金的业绩比较基准。绝大部分下跌来源于 4、5 月份，本基金持股中部分中小盘股票持续弱势是本基金半年表现不佳的主要原因。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长信睿进混合 A 基金份额净值为 0.920 元，本报告期内长信睿进混合 A 基金份额净值增长率为-2.23%；截至本报告期末长信睿进混合 C 基金份额净值为 0.900 元，本报告期内长信睿进混合 C 基金份额净值增长率为-2.70%。同期业绩比较基准收益率为 6.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年市场大概率将维持区间震荡,且有较大可能是先涨后跌。在偏宽松货币政策的支持下,我们认为三季度市场将大概率延续 6 月底以来的反弹行情,并在 7、8 月份形成一波上攻;不过目前部分投资者对 9 月份杭州 G20 会议期待过高,而实际上全球经济已经深陷泥潭多年,很难靠一两次会议就振奋起来,并且中国 5 月的基建、制造业、地产投资均全面下滑,保增长压力山大,不排除下半年 GDP 增速会迫近 6.5%,所以 9 月份以后需要警惕经济数据证伪,大盘回落的风险。在行业选择方面,我们认为中期经济难有起色,下半年周期股再有超额收益的概率较小,因此我们将重点关注景气向上行业,如券商、军工、新能源汽车、钢铁等。另外,随着市场风险偏好的提升,下半年市场风格很可能又从周期股切回成长股,我们看好人工智能、现代服务、智能驾驶等领域未来的投资机会;但由于并购借壳监管趋严,主要依赖外延的小盘股明年业绩增速必然放慢,估值中枢也有继续下移的风险,所以下半年需要选择业绩确认性强的真正成长股,规避有监管层核准风险和偏主题投资的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,长信基金管理有限责任公司(以下简称“公司”)制订了健全、有效的估值政策和程序,成立了估值工作小组,小组成员由基金事务部、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。基金经理不直接参与估值决策,如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法,可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。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,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。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内,未签订与估值相关的定价服务。

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、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

3、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；

4、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；

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

本报告期内，本基金托管人在对长信睿进灵活配置混合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，长信睿进灵活配置混合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睿进灵活配置混合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，长信睿进灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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睿进灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	9,359,274.97	13,584,344.03
结算备付金		130,464.71	92,429.11
存出保证金		90,382.90	90,103.74
交易性金融资产	6.4.6.2	43,502,122.24	61,507,211.34
其中：股票投资		43,502,122.24	61,507,211.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	13,164.52
应收利息	6.4.6.5	1,609.37	1,969.88
应收股利		-	-
应收申购款		6,297.91	41,846.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		53,090,152.10	75,331,069.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		536,655.91	2,215,387.01
应付赎回款		19,596.74	41,670.13
应付管理人报酬		64,685.55	94,309.74
应付托管费		10,780.91	15,718.25
应付销售服务费		29,845.85	43,358.34
应付交易费用	6.4.6.7	125,791.11	88,905.29

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	154,222.64	240,006.21
负债合计		941,578.71	2,739,354.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	57,752,313.31	78,279,036.84
未分配利润	6.4.6.10	-5,603,739.92	-5,687,322.33
所有者权益合计		52,148,573.39	72,591,714.51
负债和所有者权益总计		53,090,152.10	75,331,069.48

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.903 元，基金份额总额 57,752,313.31 份。其中长信睿进混合 A 基金份额净值 0.920 元，份额总额 7,765,963.35 份，长信睿进混合 C 基金份额净值 0.900 元，份额总额 49,986,349.96 份。

6.2 利润表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-134,185.84	-22,655,847.43
1.利息收入		69,656.77	47,624.27
其中：存款利息收入	6.4.6.11	38,811.60	47,624.27
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,845.17	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,754,821.32	-13,776,453.30
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-10,130,521.14	-14,235,357.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	375,699.82	458,904.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	9,540,912.01	-9,122,034.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	10,066.70	195,016.52
减：二、费用		1,273,701.99	1,800,550.74
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	453,803.59	719,973.01
2. 托管费	6.4.9.2.2	75,633.94	119,995.48
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	208,499.90	317,755.50
4. 交易费用	6.4.6.19	418,126.21	510,037.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.6.20	117,638.35	132,789.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,407,887.83	-24,456,398.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,407,887.83	-24,456,398.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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）	78,279,036.84	-5,687,322.33	72,591,714.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,407,887.83	-1,407,887.83
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）	-20,526,723.53	1,491,470.24	-19,035,253.29
其中：1.基金申购款	6,089,561.40	-456,637.10	5,632,924.30
2.基金赎回款	-26,616,284.93	1,948,107.34	-24,668,177.59
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)	57,752,313.31	-5,603,739.92	52,148,573.39
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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)	110,129,186.63	20,376,303.61	130,505,490.24
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	-24,456,398.17	-24,456,398.17
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)	-14,961,123.08	768,802.04	-14,192,321.04
其中：1.基金申购款	60,178,784.94	-1,989,775.07	58,189,009.87
2.基金赎回款	-75,139,908.02	2,758,577.11	-72,381,330.91
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)	95,168,063.55	-3,311,292.52	91,856,771.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

成善栋

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予长信睿进灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1164号)准予注册,由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》及其配套规则和《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015

年 7 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

本基金于 2015 年 6 月 17 日至 2015 年 6 月 30 日募集，募集资金总额人民币 308,524,024.87 元，利息转份额人民币 80,129.80 元，募集规模为 308,604,154.67 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 1500365 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信睿进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 0%-95%；债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%-100%。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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会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[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008]1 号文《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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	9,359,274.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,359,274.97

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,093,593.24	43,502,122.24	408,529.00
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	43,093,593.24	43,502,122.24	408,529.00

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,519.91
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	52.83
应收债券利息	-
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	-
其他	36.63
合计	1,609.37

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	125,791.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	125,791.11

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	84.29
预提费用	154,138.35
预提信息披露费	-
预提审计费	-
合计	154,222.64

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信睿进混合 A	
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,235,605.35	10,235,605.35
本期申购	707,587.54	707,587.54
本期赎回(以“-”号填列)	-3,177,229.54	-3,177,229.54
- 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	7,765,963.35	7,765,963.35

金额单位：人民币元

长信睿进混合 C		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,043,431.49	68,043,431.49
本期申购	5,381,973.86	5,381,973.86
本期赎回(以“-”号填列)	-23,439,055.39	-23,439,055.39
- 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	49,986,349.96	49,986,349.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信睿进混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	321,403.18	-921,496.49	-600,093.31
本期利润	-1,504,253.86	1,330,973.77	-173,280.09
本期基金份额交易产生的变动数	153,555.25	-1,651.53	151,903.72
其中：基金申购款	-51,212.48	3,268.71	-47,943.77
基金赎回款	204,767.73	-4,920.24	199,847.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,029,295.43	407,825.75	-621,469.68

单位：人民币元

长信睿进混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,017,978.34	-6,105,207.36	-5,087,229.02
本期利润	-9,444,545.98	8,209,938.24	-1,234,607.74

本期基金份额交易产生的变动数	938,358.56	401,207.96	1,339,566.52
其中：基金申购款	-383,911.78	-24,781.55	-408,693.33
基金赎回款	1,322,270.34	425,989.51	1,748,259.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,488,209.08	2,505,938.84	-4,982,270.24

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	35,830.85
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	2,192.15
其他	788.60
合计	38,811.60

注：其他为保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	143,424,740.11
减：卖出股票成本总额	153,555,261.25
买卖股票差价收入	-10,130,521.14

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益**6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	375,699.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	375,699.82

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	9,540,912.01
——股票投资	9,540,912.01
——债券投资	-
——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	-
合计	9,540,912.01

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	10,024.03
转换费收入	42.67
合计	10,066.70

注：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。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	418,126.21
银行间市场交易费用	-
合计	418,126.21

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	79,343.16
账户维护费	13,500.00
其他费用	-
合计	117,638.35

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.7.1 或有事项**

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心（有限合伙）和上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于 2017 年 2 月 8 日就上述股东变更事项进行公告。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
广发证券	143,424,740.11	100.00%	328,921,071.18	100.00%

6.4.9.1.2 债券交易

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交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交 总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成 交总额的比例
广发证券	80,000,000.00	100.00%	0.00	0.00%

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	250,812.18	100.00%	125,791.11	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	306,324.38	100.00%	110,817.11	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用广发证券股份有限公司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，还从广发证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

6.4.9.2 关联方报酬**6.4.9.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	453,803.59
其中：支付销售机构的客户维护费	206,774.17	338,511.45

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付	75,633.94

的托管费		
------	--	--

注：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，按月支付。

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

6.4.9.2.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	1,945.31	1,945.31
广发证券	-	155,365.43	155,365.43
长江证券	-	40.38	40.38
合计	-	157,351.12	157,351.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	7,187.01	7,187.01
广发证券	-	225,764.49	225,764.49
长江证券	-	137.89	137.89
合计	-	233,089.39	233,089.39

注：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年费率为 0.80%。

销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.80%年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	9,359,274.97	35,830.85	11,649,145.56	41,965.70

注：本基金通过“广发证券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的结算备付金，于2017年6月30日的相关余额为人民币130,464.71元（2016年12月31日的相关余额为人民币92,429.11元）。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 利润分配情况

注：本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.11 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	----------------	----------	----------------	-------	------------	--------	----

600146	商赢 环球	2017 年 1 月 5 日	重大资 产重组	32.36	-	-	46,423	1,574,290.85	1,502,248.28	-
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重大事 项停牌	22.29	-	-	8,800	190,091.00	196,152.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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

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的建设，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，量化投资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。

本基金管理人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。

6.4.12.2 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广发证券股份有限公司在中国建设银行股份有限公司开立的托管账户，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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有短期信用评级债券。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级债券。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的量化投资部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。本基金的基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临利率敏感性缺口进行监控。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30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	9,359,274.97	-	-	-	-	9,359,274.97
结算备付金	130,464.71	-	-	-	-	130,464.71
存出保证金	90,382.90	-	-	-	-	90,382.90
交易性金融资产	-	-	-	-	43,502,122.24	43,502,122.24
应收利息	-	-	-	-	1,609.37	1,609.37
应收申购款	-	-	-	-	6,297.91	6,297.91
资产总计	9,580,122.58	-	-	-	43,510,029.52	53,090,152.10
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	536,655.91	536,655.91
应付赎回款	-	-	-	-	19,596.74	19,596.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	64,685.55	64,685.55

应付托管费	-	-	-	-	10,780.91	10,780.91
应付销售服务费	-	-	-	-	29,845.85	29,845.85
应付交易费用	-	-	-	-	125,791.11	125,791.11
其他负债	-	-	-	-	154,222.64	154,222.64
负债总计	-	-	-	-	941,578.71	941,578.71
利率敏感度缺口	9,580,122.58	-	-	-	-42,568,450.81	52,148,573.39
上年度末 2016 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	13,584,344.03	-	-	-	-	13,584,344.03
结算备付金	92,429.11	-	-	-	-	92,429.11
存出保证金	90,103.74	-	-	-	-	90,103.74
交易性金融资产	-	-	-	-	61,507,211.34	61,507,211.34
应收证券清算款	-	-	-	-	13,164.52	13,164.52
应收利息	-	-	-	-	1,969.88	1,969.88
应收申购款	-	-	-	-	41,846.86	41,846.86
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,766,876.88	-	-	-	-61,564,192.60	75,331,069.48
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,215,387.01	2,215,387.01
应付赎回款	-	-	-	-	41,670.13	41,670.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	94,309.74	94,309.74
应付托管费	-	-	-	-	15,718.25	15,718.25
应付销售服务费	-	-	-	-	43,358.34	43,358.34
应付交易费用	-	-	-	-	88,905.29	88,905.29
其他负债	-	-	-	-	240,006.21	240,006.21
负债总计	-	-	-	-	2,739,354.97	2,739,354.97
利率敏感度缺口	13,766,876.88	-	-	-	-58,824,837.63	72,591,714.51

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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场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，所面临的最大其他市场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市场价格风险，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) 指标等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 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	43,502,122.24	83.42	61,507,211.34	84.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	43,502,122.24	83.42	61,507,211.34	84.73

6.4.12.4.3.2 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 1.31%（2016 年 12 月 31 日 VaR 值为 2.43%）	-683,417.28	-1,763,978.66

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。2016 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

项目	本期末 2017年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
股票投资	41,803,721.96	1,698,400.28		43,502,122.24
债券投资	-	-	-	-
合计	41,803,721.96	1,698,400.28		43,502,122.24

2017年上半年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与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的层次。

2017年上半年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2)其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	43,502,122.24	81.94
	其中：股票	43,502,122.24	81.94
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,489,739.68	17.87
7	其他各项资产	98,290.18	0.19
8	合计	53,090,152.10	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,387,244.00	4.58
C	制造业	14,997,839.85	28.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	795,664.00	1.53
E	建筑业	1,209,141.00	2.32
F	批发和零售业	960,551.20	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	574,615.00	1.10
H	住宿和餐饮业	197,884.20	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,664,514.00	3.19
J	金融业	14,143,015.80	27.12
K	房地产业	5,028,341.19	9.64

L	租赁和商务服务业	94,016.00	0.18
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	234,926.00	0.45
R	文化、体育和娱乐业	1,113,675.00	2.14
S	综合	100,695.00	0.19
	合计	43,502,122.24	83.42

7.2.2 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。

7.3 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	32,500	1,612,325.00	3.09
2	600146	商赢环球	46,423	1,502,248.28	2.88
3	600036	招商银行	40,100	958,791.00	1.84
4	000651	格力电器	20,700	852,219.00	1.63
5	000333	美的集团	19,300	830,672.00	1.59
6	600999	招商证券	47,100	811,062.00	1.56
7	600000	浦发银行	62,920	795,938.00	1.53
8	000671	阳光城	136,200	792,684.00	1.52
9	600061	国投安信	50,420	784,031.00	1.50
10	601788	光大证券	50,500	753,965.00	1.45
11	601877	正泰电器	37,400	751,366.00	1.44
12	601166	兴业银行	44,100	743,526.00	1.43
13	601169	北京银行	80,200	735,434.00	1.41
14	601928	凤凰传媒	75,100	732,976.00	1.41
15	002152	广电运通	87,750	729,202.50	1.40
16	601998	中信银行	115,600	727,124.00	1.39
17	601328	交通银行	116,600	718,256.00	1.38
18	600519	贵州茅台	1,500	707,775.00	1.36
19	600837	海通证券	47,500	705,375.00	1.35
20	600016	民生银行	81,300	668,286.00	1.28
21	600637	东方明珠	30,500	660,935.00	1.27

22	600067	冠城大通	78,197	537,213.39	1.03
23	600177	雅戈尔	51,100	517,132.00	0.99
24	000761	本钢板材	98,100	513,063.00	0.98
25	600823	世茂股份	103,980	509,502.00	0.98
26	002202	金风科技	32,800	507,416.00	0.97
27	600383	金地集团	44,000	504,680.00	0.97
28	600703	三安光电	24,500	482,650.00	0.93
29	600031	三一重工	50,700	412,191.00	0.79
30	600639	浦东金桥	22,600	409,512.00	0.79
31	601601	中国太保	11,900	403,053.00	0.77
32	000858	五 粮 液	7,200	400,752.00	0.77
33	600588	用友网络	22,900	392,048.00	0.75
34	000540	中天金融	56,400	391,980.00	0.75
35	000686	东北证券	37,900	380,895.00	0.73
36	000750	国海证券	68,500	376,750.00	0.72
37	000002	万 科 A	15,000	374,550.00	0.72
38	600015	华夏银行	40,440	372,856.80	0.71
39	601555	东吴证券	32,900	369,467.00	0.71
40	000568	泸州老窖	7,200	364,176.00	0.70
41	600297	广汇汽车	48,230	363,171.90	0.70
42	601818	光大银行	89,500	362,475.00	0.70
43	601398	工商银行	68,900	361,725.00	0.69
44	300182	捷成股份	37,300	356,588.00	0.68
45	002304	洋河股份	4,100	355,921.00	0.68
46	601288	农业银行	100,500	353,760.00	0.68
47	601988	中国银行	95,300	352,610.00	0.68
48	600028	中国石化	58,400	346,312.00	0.66
49	600422	昆药集团	28,900	327,726.00	0.63
50	600276	恒瑞医药	6,100	308,599.00	0.59
51	000919	金陵药业	27,488	297,420.16	0.57
52	000718	苏宁环球	49,700	291,242.00	0.56
53	601225	陕西煤业	40,600	287,042.00	0.55
54	000338	潍柴动力	21,600	285,120.00	0.55
55	601336	新华保险	5,400	277,560.00	0.53
56	600188	兖州煤业	22,600	276,624.00	0.53
57	000983	西山煤电	31,000	271,870.00	0.52
58	600373	中文传媒	11,500	270,365.00	0.52
59	601857	中国石油	35,100	269,919.00	0.52
60	600030	中信证券	15,800	268,916.00	0.52

61	000039	中集集团	14,900	268,647.00	0.52
62	000963	华东医药	5,400	268,380.00	0.51
63	600068	葛洲坝	23,800	267,512.00	0.51
64	002081	金螳螂	24,000	263,520.00	0.51
65	000876	新希望	31,400	258,108.00	0.49
66	600887	伊利股份	11,900	256,921.00	0.49
67	002065	东华软件	11,700	254,943.00	0.49
68	600582	天地科技	55,300	253,827.00	0.49
69	601958	金铝股份	35,400	253,818.00	0.49
70	601600	中国铝业	55,800	252,216.00	0.48
71	000630	铜陵有色	88,500	251,340.00	0.48
72	600048	保利地产	25,100	250,247.00	0.48
73	601668	中国建筑	25,800	249,744.00	0.48
74	000703	恒逸石化	17,500	249,200.00	0.48
75	000001	平安银行	26,500	248,835.00	0.48
76	601633	长城汽车	18,700	248,523.00	0.48
77	000157	中联重科	55,200	247,848.00	0.48
78	600585	海螺水泥	10,900	247,757.00	0.48
79	601800	中国交建	15,500	246,295.00	0.47
80	601111	中国国航	25,200	245,700.00	0.47
81	600867	通化东宝	13,460	245,510.40	0.47
82	002470	金正大	32,577	245,304.81	0.47
83	601899	紫金矿业	71,300	244,559.00	0.47
84	000725	京东方A	58,600	243,776.00	0.47
85	000800	一汽轿车	23,900	243,063.00	0.47
86	600674	川投能源	24,700	242,554.00	0.47
87	600256	广汇能源	58,200	240,948.00	0.46
88	600376	首开股份	20,900	239,096.00	0.46
89	000027	深圳能源	35,100	236,223.00	0.45
90	300015	爱尔眼科	10,100	234,926.00	0.45
91	600518	康美药业	10,700	232,618.00	0.45
92	600535	天士力	5,500	228,470.00	0.44
93	601006	大秦铁路	26,900	225,691.00	0.43
94	600021	上海电力	18,100	218,829.00	0.42
95	600754	锦江股份	7,302	197,884.20	0.38
96	601088	中国神华	8,800	196,152.00	0.38
97	600104	上汽集团	6,200	192,510.00	0.37
98	600628	新世界	16,100	185,955.00	0.36
99	601390	中国中铁	21,000	182,070.00	0.35

100	600826	兰生股份	7,903	143,044.30	0.27
101	600572	康恩贝	17,800	123,176.00	0.24
102	300032	金龙机电	8,600	119,970.00	0.23
103	002385	大北农	18,800	118,252.00	0.23
104	002250	联化科技	8,180	116,974.00	0.22
105	002191	劲嘉股份	12,200	114,192.00	0.22
106	002004	华邦健康	14,400	112,752.00	0.22
107	000156	华数传媒	7,400	110,334.00	0.21
108	600748	上实发展	14,804	106,588.80	0.20
109	601311	骆驼股份	7,500	106,200.00	0.20
110	600216	浙江医药	10,700	106,037.00	0.20
111	000031	中粮地产	13,800	103,914.00	0.20
112	600611	大众交通	18,700	103,224.00	0.20
113	603001	奥康国际	5,436	102,142.44	0.20
114	600805	悦达投资	13,700	100,695.00	0.19
115	600864	哈投股份	11,800	98,058.00	0.19
116	002344	海宁皮城	11,300	94,016.00	0.18
117	002588	史丹利	12,200	93,818.00	0.18
118	601908	京运通	18,400	88,320.00	0.17
119	601238	广汽集团	71	1,850.26	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600340	华夏幸福	2,649,034.00	3.65
2	300324	旋极信息	1,998,293.34	2.75
3	600028	中国石化	1,507,857.80	2.08
4	601318	中国平安	1,473,607.00	2.03
5	002304	洋河股份	1,471,097.00	2.03
6	601611	中国核建	1,469,126.00	2.02
7	601857	中国石油	1,426,672.00	1.97
8	600030	中信证券	1,407,374.00	1.94
9	601600	中国铝业	1,397,208.00	1.92
10	600585	海螺水泥	1,393,236.00	1.92
11	600048	保利地产	1,389,023.00	1.91

12	601633	长城汽车	1,387,557.00	1.91
13	601899	紫金矿业	1,383,165.00	1.91
14	000027	深圳能源	1,367,214.00	1.88
15	600500	中化国际	1,350,877.82	1.86
16	601390	中国中铁	1,343,032.00	1.85
17	300228	富瑞特装	1,335,822.00	1.84
18	600104	上汽集团	1,332,834.00	1.84
19	600999	招商证券	1,237,693.00	1.71
20	002045	国光电器	1,220,682.00	1.68

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。

7.4.2 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	600990	四创电子	7,203,191.99	9.92
2	601198	东兴证券	6,362,541.35	8.76
3	600309	万华化学	5,700,031.00	7.85
4	601688	华泰证券	5,098,841.00	7.02
5	000796	凯撒旅游	4,568,897.82	6.29
6	002544	杰赛科技	3,704,566.59	5.10
7	002024	苏宁云商	3,086,795.00	4.25
8	000718	苏宁环球	3,047,401.50	4.20
9	600340	华夏幸福	2,744,391.00	3.78
10	002500	山西证券	2,596,088.00	3.58
11	600166	福田汽车	2,230,643.00	3.07
12	000018	神州长城	2,163,407.00	2.98
13	300324	旋极信息	2,122,701.84	2.92
14	002202	金风科技	1,939,449.00	2.67
15	300156	神雾环保	1,938,672.00	2.67
16	600061	国投安信	1,859,114.00	2.56
17	000683	远兴能源	1,849,434.00	2.55
18	000059	华锦股份	1,707,758.00	2.35
19	600820	隧道股份	1,701,552.00	2.34
20	002045	国光电器	1,563,916.00	2.15

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，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	126,009,260.14
卖出股票收入（成交）总额	143,424,740.11

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 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	90,382.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,609.37
5	应收申购款	6,297.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,290.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600146	商赢环球	1,502,248.28	2.88	重大资产重组

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
长信睿进混合 A	687	11,304.17	0.00	0.00%	7,765,963.35	100.00%
长信睿进混合 C	2,206	22,659.27	0.00	0.00%	49,986,349.96	100.00%
合计	2,893	19,962.78	0.00	0.00%	57,752,313.31	100.00%

8.2 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	长信睿进混合 A	0.00	0.00%
	长信睿进混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 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	长信睿进混合 A	0
	长信睿进混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信睿进混合 A	0
	长信睿进混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信睿进混合 A	长信睿进混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 6 日）基金份额总额	34,971,320.32	273,632,834.35
本报告期期初基金份额总额	10,235,605.35	68,043,431.49
本报告期基金总申购份额	707,587.54	5,381,973.86
减：本报告期基金总赎回份额	3,177,229.54	23,439,055.39
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	7,765,963.35	49,986,349.96

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	

广发证券	2	269,313,550.74	100.00%	250,812.18	100.00%	-
------	---	----------------	---------	------------	---------	---

10.7.2 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
广发证券	-	-	80,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

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：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 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。

10.8 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开放式证券投资基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月12日
2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月13日
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月14日

		站	
4	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年1月17日
5	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、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年1月17日
6	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年1月21日
7	长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年2月8日
8	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（2017年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年2月18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、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年2月23日
10	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宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月10日
11	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月18日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月22日
13	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月22日
14	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月27日
15	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月29日
16	长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通过直销中心认购、申购旗下部分基金费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网 站	2017年3月30日
17	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含	上证报、中证报、 证券时报、公司网	2017年3月31日

	转换转入、定期定额投资) 业务的公告	站	
18	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 4 月 1 日
19	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 4 月 22 日
20	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、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 4 月 22 日
21	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)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 公司网站	2017 年 5 月 4 日
22	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 5 月 12 日
23	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 5 月 24 日
24	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泰证券股份有限公司申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 5 月 26 日
25	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、中证报、 证券时报、公司网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信睿进灵活配置混合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。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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

2017年8月24日