

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 8 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金
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	1,115,205,357.17 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</p>

	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	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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		成善栋	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报和上海证券报
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，上海市仙霞路 18 号

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

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)
本期已实现收益	-38,283,420.80
本期利润	-44,447,707.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0503
本期加权平均净值利润率	-5.49%
本期基金份额净值增长率	-5.93%
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	-124,596,054.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1117
期末基金资产净值	990,609,302.39
期末基金份额净值	0.888
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	-11.20%

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。

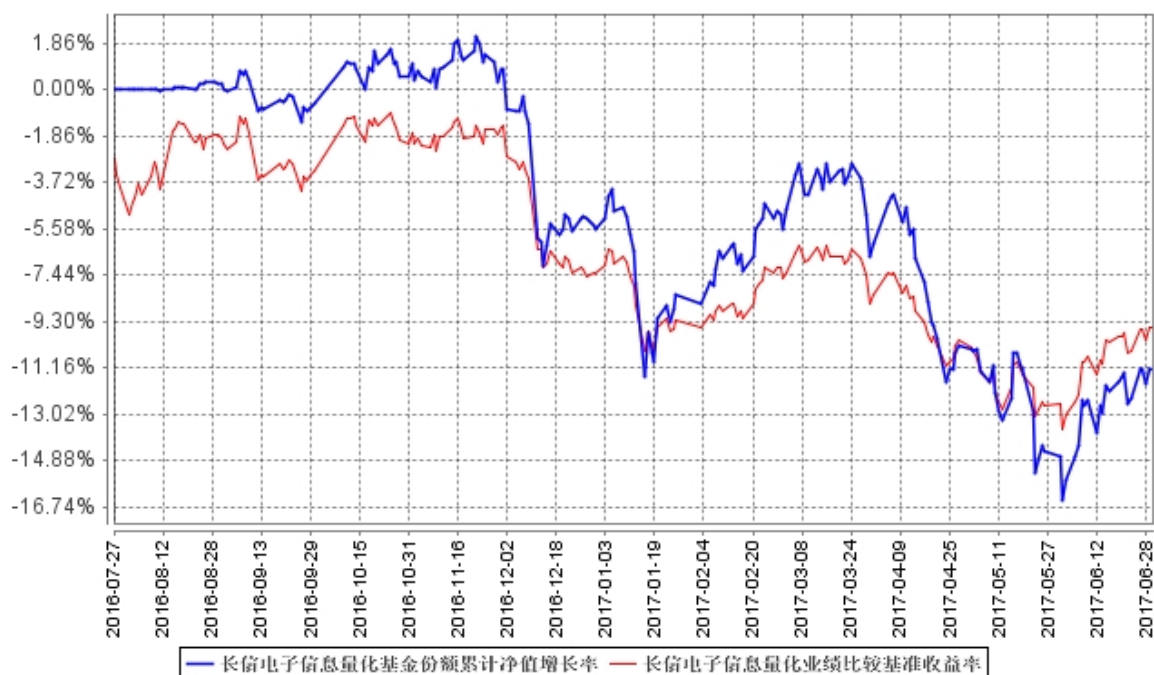
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	4.10%	1.01%	3.51%	0.64%	0.59%	0.37%
过去三个月	-5.33%	1.00%	-1.36%	0.59%	-3.97%	0.41%
过去六个月	-5.93%	0.97%	-2.31%	0.57%	-3.62%	0.40%
自基金合同生效起至今	-11.20%	0.83%	-9.52%	0.61%	-1.68%	0.22%

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、本基金基金合同生效日为 2016 年 7 月 27 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 2016 年 7 月 27 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日起 6 个月内为建仓期。报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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		
左金保	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、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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、长信先利半年定期开放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、量化投资部总监	2016年7月27日	-	7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公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任量化投资部总监、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、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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、长信先利半年定期开放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。

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

截止 2017 年 6 月 30 日，长信电子信息行业量化净值为 0.888，报告期内基金净值收益率为 -5.93%，同期业绩比较基准收益率为 -2.31%。

2017 上半年，价值蓝筹风格基本贯穿始终，大小盘分化十分显著，低估绩优白马股成为市场投资热点，食品饮料、家电等行业几乎全程领涨市场，动量效应十分显著。TMT 领域内差异较大，高成长高估值的计算机、传媒行业受到较大调整，以大阴线结束半年行情；而电子元器件经过市场调整后反弹迅速，具体的，上证综指收涨 2.86%，沪深 300 收涨 10.78%，中证 500 回调

2%，中证 1000 回调 12.07%，创业板指回调 7.34%，中小板指收涨 7.33%，计算机（中信）回调 13.23%，传媒（中信）-11.98%，通信（中信）-1.95%，电子元器件（中信）收涨 9.08%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.888 元，份额累计净值为 0.888 元，本报告期内基金净值增长率-5.93%，同期业绩基准收益率为-2.31%。

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，今年以来经济增长表现出较强的韧性，市场利率再大幅上升基本无太大可能，利率如能维持甚至下行，将使得股债向暖。后期，在流动性由紧向松以及中报、三季报业绩驱动下，前期极端行情大概率不会出现。

具体到 TMT 领域，从行业整体基本面以及市场风险偏好来看，计算机等行业估值仍高，难有大的趋势性的行情，但在景气度高且业绩确定性强的细分板块，如手游板块、苹果产业链等，或有结构性行情。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、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

2017 年度上半年，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

2017 年度上半年，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2017 年度上半年，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半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 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：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	172,007,183.18	100,760,453.96
结算备付金		550,511.44	101,975,917.59
存出保证金		57,536.22	217,234.64
交易性金融资产	6.4.6.2	823,609,779.46	643,932,493.96
其中：股票投资		823,609,779.46	643,932,493.96
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		19,003,215.07	-
应收利息	6.4.6.5	29,400.73	57,030.00
应收股利		-	-
应收申购款		19,701.07	671,448.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		1,015,277,327.17	847,614,578.37
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		22,565,875.76	-
应付赎回款		344,607.18	981,820.61
应付管理人报酬		1,048,349.94	1,109,481.40
应付托管费		174,725.03	184,913.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	350,296.19	773,014.67

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	184,170.68	151,405.07
负债合计		24,668,024.78	3,200,635.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,115,205,357.17	894,058,293.77
未分配利润	6.4.6.10	-124,596,054.78	-49,644,350.72
所有者权益合计		990,609,302.39	844,413,943.05
负债和所有者权益总计		1,015,277,327.17	847,614,578.37

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.888 元，基金份额总额

1,115,205,357.17 份；

2、本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 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：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
一、收入		-35,564,881.72
1.利息收入		448,200.99
其中：存款利息收入	6.4.6.11	448,200.99
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,984,052.86
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-32,610,059.16
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	2,626,006.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-6,164,286.43

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	135,256.58
减：二、费用		8,882,825.51
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	5,999,950.71
2. 托管费	6.4.9.2.2	999,991.80
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.6.19	1,725,934.26
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	156,948.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,447,707.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,447,707.23

注：本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 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：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）	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）	-	-44,447,707.23	-44,447,707.23
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）	221,147,063.40	-30,503,996.83	190,643,066.57
其中：1.基金申购款	318,863,693.43	-38,594,411.17	280,269,282.26
2.基金赎回款	-97,716,630.03	8,090,414.34	-89,626,215.69

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）	1,115,205,357.17	-124,596,054.78	990,609,302.39

注：本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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”）于 2016 年 6 月 1 日获中国证监会《关于准予长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1196 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《长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 7 月 27 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，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

本基金募集期自 2016 年 6 月 27 日至 2016 年 7 月 22 日止。经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金（含利息结转份额）891,999,358.96 份基金份额，有效认购户数为 6,603 户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《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》（更新）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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金业绩比较基准为: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%

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	172,007,183.18
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	172,007,183.18

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	884,667,733.17	823,609,779.46	-61,057,953.71
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	884,667,733.17	823,609,779.46	-61,057,953.71

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/负债。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购取得的债券。

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	27,754.50
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	222.93
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	1,423.30
合计	29,400.73

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	350,296.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	350,296.19

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	1,281.36
预提费用	-
预提信息披露费-中证报	49,588.57
预提信息披露费-上证报	49,588.57
预提审计费	83,712.18
合计	184,170.68

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	894,058,293.77	894,058,293.77
本期申购	318,863,693.43	318,863,693.43
本期赎回(以“-”号填列)	-97,716,630.03	-97,716,630.03
- 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	1,115,205,357.17	1,115,205,357.17

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,451,669.73	-53,096,020.45	-49,644,350.72
本期利润	-38,283,420.80	-6,164,286.43	-44,447,707.23
本期基金份额交易产生的变动数	-8,386,778.03	-22,117,218.80	-30,503,996.83
其中：基金申购款	-10,904,133.63	-27,690,277.54	-38,594,411.17

基金赎回款	2,517,355.60	5,573,058.74	8,090,414.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,218,529.10	-81,377,525.68	-124,596,054.78

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	348,280.10
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	91,188.13
其他	8,732.76
合计	448,200.99

注：其他为申购款利息收入 7,399.94 元，保证金利息收入 1,332.82 元。

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	566,440,032.14
减：卖出股票成本总额	599,050,091.30
买卖股票差价收入	-32,610,059.16

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	2,626,006.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,626,006.30

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	-6,164,286.43
——股票投资	-6,164,286.43
——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	-6,164,286.43

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	118,860.38
转换费收入	16,396.20
合计	135,256.58

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	1,725,934.26
银行间市场交易费用	-
合计	1,725,934.26

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	34,712.18
信息披露费	99,177.14
帐户维护费	18,300.00
其他费用	4,759.42
合计	156,948.74

注：其他费用为银行手续费等。

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
交通银行股份有限公司	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	555,166,951.01	41.21%

注：1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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
长江证券	461,512.80	44.38%	306,394.54	87.47%

注：1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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长江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，还从长江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
当期发生的基金应支付的管理费	5,999,950.71
其中：支付销售机构的客户维护费	2,435,013.37

注：1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

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
当期发生的基金应支付的托管费	999,991.80

注：1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 27 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(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：本报告期内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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	172,007,183.18	348,280.10

注：1、本基金基金合同于2016年7月27日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金无通过“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的结算备付金(2016年12月31日相关余额为人民币101,975,917.59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：本基金在本报告期末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**

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 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

002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
600602	云赛智联	2017年6月22日	因刊登重要事项公告	7.51	2017-7-4	7.80	1,064,005	10,387,447.71	7,990,677.55	-
300134	大富科技	2017年2月9日	拟筹划重大资产重组	23.36	-	-	228,500	6,270,655.18	5,337,760.00	-
600136	当代明诚	2017年2月14日	拟筹划重大资产重组	16.79	-	-	315,575	4,925,060.24	5,298,504.25	-
300291	华录百纳	2017年4月	拟筹划重大资产重组	20.02	-	-	263,262	5,182,192.26	5,270,505.24	-

		月 19 日	组							
300065	海兰信	2016 年 12 月 08 日	拟筹划重大资产重组	25.63	2017-7-6	23.07	188,700	4,866,343.76	4,836,381.00	-
000673	当代东方	2017 年 1 月 18 日	拟筹划重大资产重组	13.53	2017-8-22	12.18	346,750	4,599,422.01	4,691,527.50	-
300209	天泽信息	2017 年 2 月 10 日	拟筹划重大资产重组	25.08	-	-	182,580	4,720,737.06	4,579,106.40	-
002619	巨龙管业	2017 年 5 月 24 日	拟筹划重大资产重组	6.37	-	-	628,560	7,303,144.00	4,003,927.20	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	拟筹划重大资产重组	24.95	2017-7-4	22.46	121,300	2,956,305.00	3,026,435.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	拟筹划重大资产重组	15.75	2017-8-9	14.50	175,501	2,690,255.30	2,764,140.75	-
300098	高新兴	2017 年 6 月 22 日	因刊登重要事项公告	12.90	2017-7-3	13.18	77,738	900,618.52	1,002,820.20	-
600460	士兰微	2017 年 5 月 12 日	拟筹划重大资产重组	6.07	2017-8-15	6.68	142,068	908,564.51	862,352.76	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	因刊登重要事项公告	18.50	2017-7-7	18.88	46,600	911,654.00	862,100.00	-
300340	科恒股份	2017 年 6 月 5 日	拟筹划重大资产重组	40.11	-	-	18,600	896,736.00	746,046.00	-
300075	数字政通	2017 年 6 月 29 日	因刊登重要事项公告	20.94	2017-7-17	18.86	32,400	904,000.00	678,456.00	-

		日								
002856	美芝股份	2017年6月19日	拟筹划重大资产重组	31.86	-	-	1,130	13,119.30	36,001.80	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	拟筹划重大资产重组	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-
000032	深桑达A	2017年2月27日	拟筹划重大资产重组	15.69	-	-	194	2,960.58	3,043.86	-
300104	乐视网	2017年4月17日	拟筹划重大资产重组	30.68	-	-	94	3,875.11	2,883.92	-
002076	雪莱特	2017年3月20日	拟筹划重大资产重组	7.07	-	-	300	2,379.21	2,121.00	-
603238	诺邦股份	2017年5月16日	拟筹划重大资产重组	29.38	2017-8-23	31.99	50	665.50	1,469.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	拟筹划重大资产重组	20.63	2017-7-3	18.01	53	1,276.90	1,093.39	-
002654	万润科技	2017年5月10日	因刊登重要事项公告	9.28	-	-	33	371.75	306.24	-
300252	金信诺	2017年4月27日	因刊登重要事项公告	21.65	2017-7-27	19.49	3	103.77	64.95	-

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行交通银行，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发行的证券，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。本基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的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	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	172,007,183.18	-	-	-	-	-	172,007,183.18
结算备付金	550,511.44	-	-	-	-	-	550,511.44
存出保证金	57,536.22	-	-	-	-	-	57,536.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-	823,609,779.46	823,609,779.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,003,215.07	19,003,215.07
应收利息	-	-	-	-	-	29,400.73	29,400.73
应收申购款	-	-	-	-	-	19,701.07	19,701.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	172,615,230.84	-	-	-	-	842,662,096.33	1,015,277,327.17
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,565,875.76	22,565,875.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	344,607.18	344,607.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,048,349.94	1,048,349.94
应付托管费	-	-	-	-	-	174,725.03	174,725.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	350,296.19	350,296.19
其他负债	-	-	-	-	-	184,170.68	184,170.68
负债总计	-	-	-	-	-	24,668,024.78	24,668,024.78
利率敏感度缺口	172,615,230.84	-	-	-	-	-817,994,071.55	990,609,302.39
上年度末 2016年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	100,760,453.96	-	-	-	-	-	100,760,453.96
结算备付金	101,975,917.59	-	-	-	-	-	101,975,917.59

存出保证金	217,234.64	-	-	-	-	217,234.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-643,932,493.96	643,932,493.96
应收利息	-	-	-	-	57,030.00	57,030.00
应收申购款	-	-	-	-	671,448.22	671,448.22
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	202,953,606.19	-	-	-	-644,660,972.18	847,614,578.37
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	981,820.61	981,820.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,109,481.40	1,109,481.40
应付托管费	-	-	-	-	184,913.57	184,913.57
应付交易费用	-	-	-	-	773,014.67	773,014.67
其他负债	-	-	-	-	151,405.07	151,405.07
负债总计	-	-	-	-	3,200,635.32	3,200,635.32
利率敏感度缺口	202,953,606.19	-	-	-	-641,460,336.86	844,413,943.05

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。

6.4.12.4.1.2 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 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	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		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	823,609,779.46	83.14	643,932,493.96	76.26
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	823,609,779.46	83.14	643,932,493.96	76.26

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 1.58%（2016 年 12 月 31 日 VaR 值为 2.93%）	-15,651,626.98	-24,741,328.53

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。

单位：人民币元

资产	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	771,473,373.00	52,136,406.46	-	823,609,779.46
债券投资	-	-	-	-
合计	771,473,373.00	52,136,406.46	-	823,609,779.46

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) 第二层次的公允价值计量

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)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，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	823,609,779.46	81.12
	其中：股票	823,609,779.46	81.12
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	172,557,694.62	17.00
7	其他各项资产	19,109,853.09	1.88
8	合计	1,015,277,327.17	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	-	-
C	制造业	482,792,458.22	48.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	74,801.30	0.01
F	批发和零售业	20,535,096.07	2.07
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	231,330,675.84	23.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,358,536.92	3.06

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	58,518,211.11	5.91
S	综合	-	-
	合计	823,609,779.46	83.14

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	002139	拓邦股份	1,151,125	12,397,616.25	1.25
2	002079	苏州固锴	1,462,000	10,774,940.00	1.09
3	002587	奥拓电子	1,386,900	10,457,226.00	1.06
4	300079	数码视讯	1,745,407	10,210,630.95	1.03
5	300365	恒华科技	275,792	9,845,774.40	0.99
6	300269	联建光电	485,598	9,726,527.94	0.98
7	000938	紫光股份	150,081	9,172,950.72	0.93
8	002188	巴士在线	350,137	8,998,520.90	0.91
9	300042	朗科科技	232,402	8,482,673.00	0.86
10	600345	长江通信	407,413	8,396,781.93	0.85
11	002415	海康威视	255,876	8,264,794.80	0.83
12	300162	雷曼股份	766,354	8,069,707.62	0.81
13	600602	云赛智联	1,064,005	7,990,677.55	0.81
14	300241	瑞丰光电	620,543	7,930,539.54	0.80
15	002475	立讯精密	270,774	7,917,431.76	0.80
16	002241	歌尔股份	388,720	7,494,521.60	0.76
17	002463	沪电股份	1,609,250	7,322,087.50	0.74
18	600203	福日电子	862,639	7,237,541.21	0.73
19	300139	晓程科技	672,274	7,052,154.26	0.71
20	002376	新北洋	510,800	7,008,176.00	0.71
21	002354	天神娱乐	323,159	6,947,918.50	0.70
22	300202	聚龙股份	414,200	6,842,584.00	0.69

23	300184	力源信息	542,400	6,747,456.00	0.68
24	300229	拓尔思	541,338	6,696,351.06	0.68
25	000823	超声电子	456,798	6,587,027.16	0.66
26	000021	深科技	766,855	6,579,615.90	0.66
27	000049	德赛电池	126,900	6,574,689.00	0.66
28	002484	江海股份	659,002	6,537,299.84	0.66
29	300287	飞利信	710,300	6,520,554.00	0.66
30	002380	科远股份	351,960	6,493,662.00	0.66
31	600757	长江传媒	867,004	6,476,519.88	0.65
32	300207	欣旺达	538,200	6,345,378.00	0.64
33	002456	欧菲光	346,175	6,289,999.75	0.63
34	300188	美亚柏科	341,100	5,897,619.00	0.60
35	300036	超图软件	357,699	5,848,378.65	0.59
36	300115	长盈精密	198,079	5,779,945.22	0.58
37	600261	阳光照明	871,818	5,727,844.26	0.58
38	600522	中天科技	474,600	5,718,930.00	0.58
39	002528	英飞拓	964,000	5,716,520.00	0.58
40	002185	华天科技	787,540	5,701,789.60	0.58
41	300373	扬杰科技	281,400	5,670,210.00	0.57
42	002449	国星光电	339,500	5,618,725.00	0.57
43	300232	洲明科技	346,000	5,536,000.00	0.56
44	601999	出版传媒	597,921	5,453,039.52	0.55
45	300150	世纪瑞尔	711,145	5,390,479.10	0.54
46	002624	完美世界	155,700	5,340,510.00	0.54
47	300134	大富科技	228,500	5,337,760.00	0.54
48	002279	久其软件	424,068	5,322,053.40	0.54
49	600136	当代明诚	315,575	5,298,504.25	0.53
50	300291	华录百纳	263,262	5,270,505.24	0.53
51	002436	兴森科技	825,000	5,197,500.00	0.52
52	300303	聚飞光电	1,192,036	5,161,515.88	0.52
53	002368	太极股份	185,515	5,136,910.35	0.52
54	002384	东山精密	206,551	5,101,809.70	0.52
55	002609	捷顺科技	334,312	5,004,650.64	0.51
56	002027	分众传媒	362,896	4,993,448.96	0.50
57	002238	天威视讯	414,127	4,928,111.30	0.50
58	000636	风华高科	571,300	4,861,763.00	0.49
59	002315	焦点科技	194,735	4,856,690.90	0.49
60	300065	海兰信	188,700	4,836,381.00	0.49
61	300058	蓝色光标	618,300	4,835,106.00	0.49

62	300212	易华录	189,208	4,773,717.84	0.48
63	002583	海能达	294,200	4,733,678.00	0.48
64	002373	千方科技	345,200	4,708,528.00	0.48
65	300053	欧比特	349,134	4,695,852.30	0.47
66	000673	当代东方	346,750	4,691,527.50	0.47
67	002222	福晶科技	327,400	4,671,998.00	0.47
68	300050	世纪鼎利	461,094	4,643,216.58	0.47
69	002093	国脉科技	527,100	4,638,480.00	0.47
70	300209	天泽信息	182,580	4,579,106.40	0.46
71	002174	游族网络	142,550	4,527,388.00	0.46
72	002156	通富微电	435,800	4,436,444.00	0.45
73	002195	二三四五	611,165	4,369,829.75	0.44
74	002152	广电运通	521,425	4,333,041.75	0.44
75	300331	苏大维格	199,900	4,327,835.00	0.44
76	300296	利亚德	230,000	4,324,000.00	0.44
77	300282	汇冠股份	204,235	4,309,358.50	0.44
78	600804	鹏博士	241,200	4,281,300.00	0.43
79	300476	胜宏科技	180,600	4,267,578.00	0.43
80	002065	东华软件	194,783	4,244,321.57	0.43
81	603118	共进股份	308,940	4,210,852.20	0.43
82	000719	大地传媒	403,200	4,205,376.00	0.42
83	002056	横店东磁	559,668	4,197,510.00	0.42
84	002446	盛路通信	343,214	4,176,914.38	0.42
85	601929	吉视传媒	1,205,200	4,169,992.00	0.42
86	600229	城市传媒	444,579	4,165,705.23	0.42
87	600105	永鼎股份	515,698	4,161,682.86	0.42
88	000733	振华科技	261,000	4,149,900.00	0.42
89	000536	华映科技	712,940	4,142,181.40	0.42
90	300182	捷成股份	432,000	4,129,920.00	0.42
91	300394	天孚通信	161,200	4,125,108.00	0.42
92	002138	顺络电子	222,000	4,124,760.00	0.42
93	300339	润和软件	327,000	4,120,200.00	0.42
94	002445	中南文化	320,485	4,118,232.25	0.42
95	600271	航天信息	198,400	4,094,976.00	0.41
96	002405	四维图新	206,800	4,086,368.00	0.41
97	002179	中航光电	130,956	4,084,517.64	0.41
98	600880	博瑞传播	624,225	4,076,189.25	0.41
99	002383	合众思壮	257,650	4,037,375.50	0.41
100	002619	巨龙管业	628,560	4,003,927.20	0.40

101	300297	蓝盾股份	365,312	4,000,166.40	0.40
102	300227	光韵达	184,309	3,997,662.21	0.40
103	002273	水晶光电	191,050	3,941,361.50	0.40
104	300352	北信源	682,350	3,937,159.50	0.40
105	300038	梅泰诺	92,741	3,927,581.35	0.40
106	300383	光环新网	288,700	3,914,772.00	0.40
107	300046	台基股份	204,139	3,817,399.30	0.39
108	002421	达实智能	614,250	3,759,210.00	0.38
109	300168	万达信息	249,100	3,624,405.00	0.37
110	002636	金安国纪	203,700	3,517,899.00	0.36
111	300183	东软载波	168,600	3,452,928.00	0.35
112	002439	启明星辰	185,000	3,441,000.00	0.35
113	300020	银江股份	246,900	3,417,096.00	0.34
114	300077	国民技术	243,500	3,333,515.00	0.34
115	000070	特发信息	281,914	3,312,489.50	0.33
116	300336	新文化	213,435	3,299,705.10	0.33
117	002292	奥飞娱乐	192,576	3,254,534.40	0.33
118	300327	中颖电子	101,091	3,204,584.70	0.32
119	300256	星星科技	303,900	3,160,560.00	0.32
120	002253	川大智胜	131,250	3,150,000.00	0.32
121	600360	华微电子	430,300	3,123,978.00	0.32
122	300343	联创互联	160,300	3,109,820.00	0.31
123	002025	航天电器	121,300	3,026,435.00	0.31
124	002308	威创股份	231,821	3,025,264.05	0.31
125	002414	高德红外	161,886	2,962,513.80	0.30
126	002657	中科金财	102,082	2,959,357.18	0.30
127	002527	新时达	273,279	2,904,955.77	0.29
128	300360	炬华科技	192,150	2,891,857.50	0.29
129	002119	康强电子	166,500	2,860,470.00	0.29
130	300248	新开普	172,373	2,787,271.41	0.28
131	300088	长信科技	175,501	2,764,140.75	0.28
132	002153	石基信息	116,265	2,642,703.45	0.27
133	300045	华力创通	251,738	2,567,727.60	0.26
134	300130	新国都	133,289	2,517,829.21	0.25
135	002045	国光电器	155,400	2,469,306.00	0.25
136	300395	菲利华	168,500	2,468,525.00	0.25
137	002017	东信和平	220,000	2,448,600.00	0.25
138	002518	科士达	166,230	2,430,282.60	0.25
139	300377	赢时胜	213,017	2,426,263.63	0.24

140	000701	厦门信达	193,928	2,424,100.00	0.24
141	600551	时代出版	152,576	2,409,175.04	0.24
142	000948	南天信息	196,900	2,394,304.00	0.24
143	600850	华东电脑	112,040	2,394,294.80	0.24
144	300270	中威电子	202,300	2,368,933.00	0.24
145	300295	三六五网	124,500	2,329,395.00	0.24
146	002416	爱施德	212,500	2,292,875.00	0.23
147	002502	骅威文化	237,400	2,229,186.00	0.23
148	002425	凯撒文化	233,304	2,132,398.56	0.22
149	300299	富春股份	111,400	2,122,170.00	0.21
150	002247	帝龙文化	158,400	2,078,208.00	0.21
151	600536	中国软件	107,700	2,063,532.00	0.21
152	000066	中国长城	209,500	1,887,595.00	0.19
153	002491	通鼎互联	139,100	1,869,504.00	0.19
154	603328	依顿电子	132,100	1,869,215.00	0.19
155	600183	生益科技	149,800	1,848,532.00	0.19
156	300468	四方精创	41,254	1,839,515.86	0.19
157	600363	联创光电	131,300	1,839,513.00	0.19
158	601900	南方传媒	147,600	1,836,144.00	0.19
159	300170	汉得信息	177,800	1,833,118.00	0.19
160	600386	北巴传媒	137,600	1,830,080.00	0.18
161	600831	广电网络	183,800	1,828,810.00	0.18
162	600845	宝信软件	108,400	1,826,540.00	0.18
163	600487	亨通光电	64,950	1,821,847.50	0.18
164	000665	湖北广电	149,882	1,821,066.30	0.18
165	601231	环旭电子	115,900	1,820,789.00	0.18
166	300002	神州泰岳	217,817	1,816,593.78	0.18
167	000541	佛山照明	199,400	1,816,534.00	0.18
168	603508	思维列控	34,300	1,813,784.00	0.18
169	603005	晶方科技	64,800	1,813,752.00	0.18
170	002106	莱宝高科	178,769	1,810,929.97	0.18
171	300025	华星创业	229,900	1,809,313.00	0.18
172	300251	光线传媒	220,900	1,809,171.00	0.18
173	300410	正业科技	50,100	1,808,610.00	0.18
174	601928	凤凰传媒	185,200	1,807,552.00	0.18
175	300047	天源迪科	143,300	1,807,013.00	0.18
176	300324	旋极信息	98,969	1,805,194.56	0.18
177	601098	中南传媒	96,800	1,804,352.00	0.18
178	300231	银信科技	136,600	1,803,120.00	0.18

179	300043	星辉娱乐	219,200	1,799,632.00	0.18
180	600037	歌华有线	123,600	1,799,616.00	0.18
181	002131	利欧股份	546,912	1,799,340.48	0.18
182	000725	京东方 A	430,700	1,791,712.00	0.18
183	002712	思美传媒	81,700	1,763,086.00	0.18
184	600584	长电科技	88,300	1,417,215.00	0.14
185	300102	乾照光电	157,610	1,345,989.40	0.14
186	300366	创意信息	76,300	1,278,788.00	0.13
187	300301	长方集团	192,400	1,231,360.00	0.12
188	002362	汉王科技	58,602	1,190,206.62	0.12
189	000997	新大陆	52,300	1,186,687.00	0.12
190	300177	中海达	103,785	1,180,035.45	0.12
191	300223	北京君正	48,000	1,168,800.00	0.12
192	300277	海联讯	132,900	1,152,243.00	0.12
193	300074	华平股份	166,749	1,138,895.67	0.11
194	300346	南大光电	46,513	1,059,101.01	0.11
195	600703	三安光电	52,900	1,042,130.00	0.11
196	300098	高新兴	77,738	1,002,820.20	0.10
197	002008	大族激光	25,500	883,320.00	0.09
198	002635	安洁科技	24,150	874,713.00	0.09
199	600652	游久游戏	80,000	873,600.00	0.09
200	000050	深天马 A	42,300	870,111.00	0.09
201	600460	士兰微	142,068	862,352.76	0.09
202	300085	银之杰	46,600	862,100.00	0.09
203	300136	信维通信	21,500	860,430.00	0.09
204	300288	朗玛信息	29,500	821,575.00	0.08
205	002055	得润电子	36,058	819,598.34	0.08
206	300133	华策影视	71,549	801,348.80	0.08
207	300328	宜安科技	71,000	788,100.00	0.08
208	002104	恒宝股份	83,100	780,309.00	0.08
209	002402	和而泰	78,400	773,024.00	0.08
210	002396	星网锐捷	39,600	766,260.00	0.08
211	300340	科恒股份	18,600	746,046.00	0.08
212	300479	神思电子	34,900	745,813.00	0.08
213	300083	劲胜精密	80,300	741,972.00	0.07
214	002071	长城影视	69,000	687,240.00	0.07
215	300317	珈伟股份	47,058	687,046.80	0.07
216	300075	数字政通	32,400	678,456.00	0.07
217	300044	赛为智能	32,400	638,280.00	0.06

218	300389	艾比森	27,000	392,580.00	0.04
219	300458	全志科技	14,800	389,832.00	0.04
220	600728	佳都科技	50,000	387,000.00	0.04
221	300219	鸿利智汇	29,000	384,540.00	0.04
222	601801	皖新传媒	27,200	375,904.00	0.04
223	300438	鹏辉能源	14,900	375,480.00	0.04
224	000977	浪潮信息	21,500	372,380.00	0.04
225	300353	东土科技	28,337	364,980.56	0.04
226	300369	绿盟科技	32,300	357,238.00	0.04
227	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
228	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.01
229	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
230	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
231	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
232	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
233	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
234	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.00
235	002856	美芝股份	1,130	36,001.80	0.00
236	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
237	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
238	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
239	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
240	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
241	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
242	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
243	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
244	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
245	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
246	603138	海量数据	395	17,569.60	0.00
247	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
248	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
249	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
250	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
251	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
252	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
253	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
254	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
255	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
256	300610	晨化股份	144	3,379.68	0.00

257	000032	深桑达 A	194	3,043.86	0.00
258	300104	乐视网	94	2,883.92	0.00
259	002076	雪莱特	300	2,121.00	0.00
260	603238	诺邦股份	50	1,469.00	0.00
261	300367	东方网力	53	1,093.39	0.00
262	300348	长亮科技	48	1,017.60	0.00
263	002654	万润科技	33	306.24	0.00
264	300252	金信诺	3	64.95	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	002587	奥拓电子	14,883,893.00	1.76
2	002380	科远股份	12,672,239.40	1.50
3	002139	拓邦股份	11,921,756.50	1.41
4	600203	福日电子	11,513,341.53	1.36
5	300162	雷曼股份	11,414,246.27	1.35
6	300353	东土科技	11,288,568.56	1.34
7	600460	士兰微	11,195,260.32	1.33
8	300079	数码视讯	11,088,884.96	1.31
9	002354	天神娱乐	10,872,957.24	1.29
10	002131	利欧股份	10,653,888.96	1.26
11	300102	乾照光电	10,215,155.90	1.21
12	300046	台基股份	9,826,123.61	1.16
13	300327	中颖电子	9,383,143.34	1.11
14	002546	新联电子	9,192,808.00	1.09
15	600707	彩虹股份	8,886,184.85	1.05
16	603688	石英股份	8,884,035.64	1.05
17	300229	拓尔思	8,837,791.52	1.05
18	002528	英飞拓	8,829,704.00	1.05
19	300269	联建光电	8,398,726.89	0.99
20	002188	巴士在线	8,084,094.80	0.96

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	300046	台基股份	20,220,035.35	2.39
2	300102	乾照光电	19,091,116.75	2.26
3	000636	风华高科	15,257,151.06	1.81
4	300036	超图软件	13,563,983.68	1.61
5	300353	东土科技	12,810,107.00	1.52
6	300348	长亮科技	11,458,603.98	1.36
7	300379	东方通	11,390,807.70	1.35
8	002148	北纬通信	11,219,796.92	1.33
9	600203	福日电子	11,014,767.56	1.30
10	002362	汉王科技	10,388,653.38	1.23
11	300327	中颖电子	10,093,453.06	1.20
12	600460	士兰微	10,073,937.00	1.19
13	002188	巴士在线	9,889,146.49	1.17
14	000673	当代东方	9,618,980.89	1.14
15	603688	石英股份	9,525,688.52	1.13
16	000032	深桑达A	9,278,554.04	1.10
17	600707	彩虹股份	9,191,863.64	1.09
18	002546	新联电子	9,091,689.00	1.08
19	300303	聚飞光电	9,060,903.80	1.07
20	002131	利欧股份	8,998,744.00	1.07

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。

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	784,891,663.23
卖出股票收入（成交）总额	566,440,032.14

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	57,536.22
2	应收证券清算款	19,003,215.07
3	应收股利	-
4	应收利息	29,400.73
5	应收申购款	19,701.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,109,853.09

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

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

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
5,681	196,304.41	406,274,720.75	36.43%	708,930,636.42	63.57%

8.2 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%

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	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

§9 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	894,058,293.77
本报告期基金总申购份额	318,863,693.43
减：本报告期基金总赎回份额	97,716,630.03
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	1,115,205,357.17

§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 基金管理人的重大人事变动

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

本报告期基金托管人专门的基金托管部门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，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	
长江证券	2	555,166,951.01	41.21%	461,512.80	44.38%	-
兴业证券	2	460,015,726.44	34.15%	382,413.09	36.77%	-
平安证券	1	100,694,184.95	7.48%	53,499.88	5.14%	-

国泰君安	1	90,465,230.55	6.72%	48,064.69	4.62%	-
华泰证券	2	74,841,216.23	5.56%	39,762.70	3.82%	-
光大证券	1	65,856,140.82	4.89%	54,746.22	5.26%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券退租	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期本基金新增租用方正证券交易单元 1 个，东北证券交易单元 1 个，退租广发证券交易单元 1 个。

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
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	长信电子信息行业量化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、 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
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
10	长信电子信息行业量化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、 公司网站	2017年3月11 日
11	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
12	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

13	长信电子信息行业量化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、 公司网站	2017 年 3 月 27 日
14	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、公司网 站	2017 年 3 月 30 日
15	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
16	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
17	长信电子信息行业量化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、 公司网站	2017 年 4 月 22 日
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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

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	2017 年 6 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日	0.00	307,656,377.55	0.00	307,656,377.55	27.59%
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>							

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、《长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《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》；
- 4、《长信电子信息行业量化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