

长信量化中小盘股票型证券投资基金 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合同规定，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.....	6
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.....	14
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.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化中小盘股票型证券投资基金
基金简称	长信量化中小盘股票
场内简称	CXLH 中小
基金主代码	519975
交易代码	519975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 4 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	3,542,287,414.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小盘股票，通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

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、上海证券报、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, 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	-92,584,105.25
本期利润	-315,122,651.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0875
本期加权平均净值利润率	-8.45%
本期基金份额净值增长率	-9.11%
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	-77,668,129.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0219
期末基金资产净值	3,464,619,285.17
期末基金份额净值	0.978
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	34.29%

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。

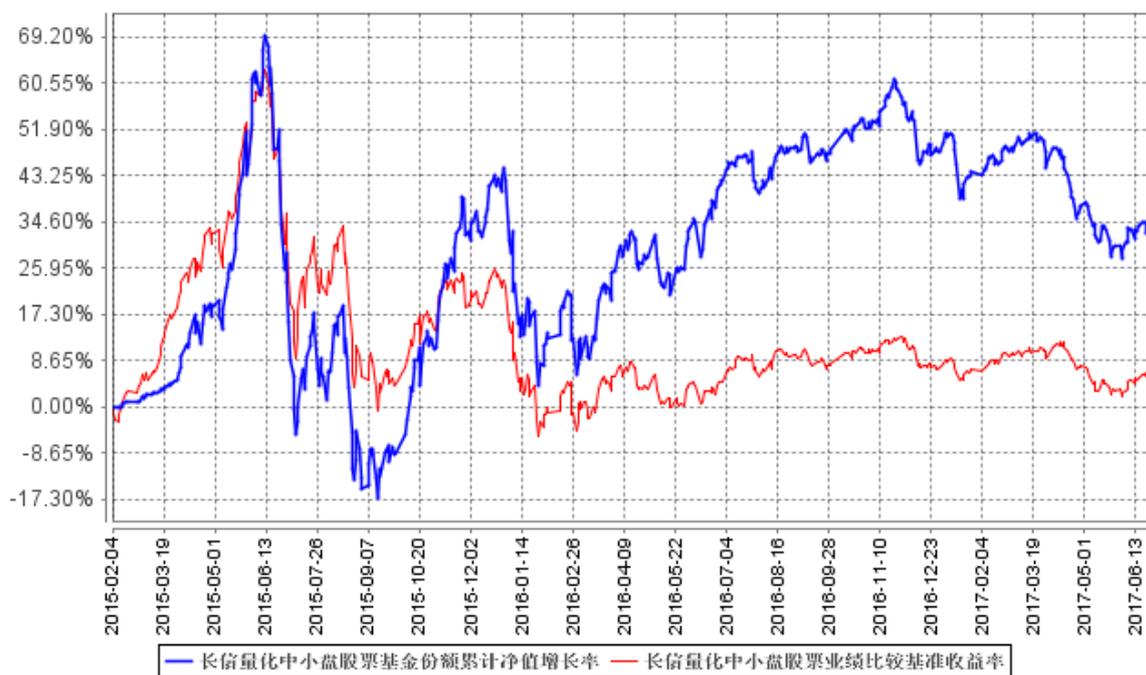
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.16%	0.97%	4.32%	0.60%	-1.16%	0.37%
过去三个月	-8.00%	1.01%	-1.71%	0.67%	-6.29%	0.34%
过去六个月	-9.11%	0.98%	0.35%	0.60%	-9.46%	0.38%
过去一年	-5.76%	0.95%	2.65%	0.63%	-8.41%	0.32%
自基金合同生效起至今	34.29%	2.13%	7.66%	1.61%	26.63%	0.52%

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 2 月 4 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例符合基金合同中的约定。

§ 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	2015年3月14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责任公司，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，量化中小盘净值为 0.978，报告期内基金净值收益率为-9.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.35%。

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，估值较低且增长稳健的白马股和蓝筹股涨幅较大，而中小成长股则大幅下跌。尤其在二季度，受金融去杠杆而引起的流动性紧张和 IPO 提速的影响，市场出现较大调整，大量小盘股一度跌破去年一月以来低点；6 月以

后，资金紧张局面暂缓，中小创迎来一波像样的反弹。尽管上半年以来指数无显著趋势行情，但阶段性的投资热点始终存在，低估绩优白马股成为市场宠儿，消费升级板块的家电行业、食品饮料行业几乎全程领涨市场，动量效应十分显著。指数表现上，大盘指数整体显著强于小盘指数，上证综指收涨 2.86%，沪深 300 收涨 10.78%，中证 500 收跌 2%，中证 1000 收跌 12.07%，创业板指收跌 7.34%，中小板指收涨 7.33%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.978 元，本报告期内本基金净值增长率为-9.11%，同期业绩比较基准涨幅为 0.35%。

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、三季度业绩驱动下，前期极端行情大概率不会出现。市场方面，我们认为上半年以来的价值股行情短时间内不会转变，下半年很可能继续延续这一行情，因此内生增长能力强，估值合理仍会是投资的主流逻辑。尽管前期涨幅较大的绩优白马股 7 月出现小幅回调，但我们认为二线价值成长和蓝筹有望接力上涨，同时前期过度调整的高成长绩优股或将迎来一波超跌反弹机会。

在宏观经济未有显著改善或未有大批增量资金入市的情况下，我们对后市持谨慎乐观的态度。届时，一些逻辑性强业绩良好的主题（诸如消费升级、国企改革）或有更多投资机会。我们将致力于寻找具有股价安全边际的优质成长股，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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，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 年上半年度，基金托管人在长信量化中小盘股票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 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信量化中小盘股票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。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

2017 年上半年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化中小盘股票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：长信量化中小盘股票型证券投资基金

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	5,981,247.23	218,698,050.57
结算备付金		770,459,910.07	441,988,463.83
存出保证金		448,048.79	839,852.14
交易性金融资产	6.4.6.2	2,834,183,986.11	3,335,433,370.40
其中：股票投资		2,834,183,986.11	3,335,433,370.40
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		-	-
应收利息	6.4.6.5	212,238.47	254,231.50
应收股利		-	-
应收申购款		1,309,854.80	15,823,688.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		3,612,595,285.47	4,013,037,656.76
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		138,146,793.71	16,681,263.72
应付赎回款		4,235,007.36	12,008,551.52
应付管理人报酬		3,945,305.31	5,040,530.25
应付托管费		657,550.88	840,088.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	715,985.36	3,960,254.72

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	275,357.68	409,140.70
负债合计		147,976,000.30	38,939,829.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	3,542,287,414.62	3,693,082,074.66
未分配利润	6.4.6.10	-77,668,129.45	281,015,752.81
所有者权益合计		3,464,619,285.17	3,974,097,827.47
负债和所有者权益总计		3,612,595,285.47	4,013,037,656.76

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.978 元，基金份额总额 3,542,287,414.62 份。

6.2 利润表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

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		-278,339,368.90	11,029,620.77
1.利息收入		4,240,232.42	254,083.73
其中：存款利息收入	6.4.6.11	4,098,223.53	254,083.73
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		142,008.89	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-64,860,508.17	9,936,573.96
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-74,991,243.28	9,003,507.05
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	10,130,735.11	933,066.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-222,538,546.01	2,762.20
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	4,819,452.86	836,200.88

减：二、费用		36,783,282.36	3,729,367.88
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	27,800,249.10	2,141,002.15
2. 托管费	6.4.9.2.2	4,633,374.80	356,833.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	4,127,875.10	1,040,879.19
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	221,783.36	190,652.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-315,122,651.26	7,300,252.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-315,122,651.26	7,300,252.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

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）	3,693,082,074.66	281,015,752.81	3,974,097,827.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-315,122,651.26	-315,122,651.26
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）	-150,794,660.04	-43,561,231.00	-194,355,891.04
其中：1. 基金申购款	1,472,498,398.75	33,571,864.62	1,506,070,263.37
2. 基金赎回款	-1,623,293,058.79	-77,133,095.62	-1,700,426,154.41
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）	3,542,287,414.62	-77,668,129.45	3,464,619,285.17

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)	204,999,315.96	86,995,065.72	291,994,381.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,300,252.89	7,300,252.89
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)	41,765,248.26	10,676,503.83	52,441,752.09
其中：1.基金申购款	184,123,486.46	46,769,788.53	230,893,274.99
2.基金赎回款	-142,358,238.20	-36,093,284.70	-178,451,522.90
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)	246,764,564.22	104,971,822.44	351,736,386.66

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

长信量化中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)已于 2012 年 3 月 27 日获中国证监会《关于核准长信量化中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]402 号)核准募集。为保护投资者利益,基金管理人于 2012 年 8 月 23 日向中国证监会提交了《长信基金管理有限责任公司关于推迟长信量化中小盘股票型证券投资基金募集时间的申请》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,对本基金进行变更注册。变更注册后的本基金于 2014 年 12 月 15

日经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1360 号文准予注册。本基金合同于 2015 年 2 月 4 日正式生效。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 2015 年 1 月 12 日至 2015 年 1 月 30 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量化中小盘股票型证券投资基金(含利息结转份额) 869,346,402.40 份基金份额，有效认购户数为 7,776 户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化中小盘股票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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期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(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于中小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期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的比例范围是基金资产的 5%-20%。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 700 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%。

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

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

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	5,981,247.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,981,247.23

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	3,231,925,803.02	2,834,183,986.11	-397,741,816.91
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	3,231,925,803.02	2,834,183,986.11	-397,741,816.91

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	81,060.62
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	124,995.96

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	6,000.36
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	181.53
合计	212,238.47

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	715,985.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	715,985.36

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	11,960.99
预提费用	-
预提信息披露费-上证报	49,588.57
预提信息披露费-中证报	49,588.57
预提信息披露费-证券时报	49,588.57
预提审计费	114,630.98
预提账户维护费	-
合计	275,357.68

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	3,693,082,074.66	3,693,082,074.66
本期申购	1,472,498,398.75	1,472,498,398.75
本期赎回(以“-”号填列)	-1,623,293,058.79	-1,623,293,058.79

- 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	3,542,287,414.62	3,542,287,414.62

注：申购含转换入份额，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	274,543,736.59	6,472,016.22	281,015,752.81
本期利润	-92,584,105.25	-222,538,546.01	-315,122,651.26
本期基金份额交易产生的变动数	-16,592,648.52	-26,968,582.48	-43,561,231.00
其中：基金申购款	91,832,575.32	-58,260,710.70	33,571,864.62
基金赎回款	-108,425,223.84	31,292,128.22	-77,133,095.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,366,982.82	-243,035,112.27	-77,668,129.45

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	1,283,174.73
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	2,793,991.87
其他	21,056.93
合计	4,098,223.53

注：其他为保证金利息和在途利息收入。

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	1,817,785,314.14
减：卖出股票成本总额	1,892,776,557.42
买卖股票差价收入	-74,991,243.28

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投资赎回差价收入。

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投资申购差价收入。

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	10,130,735.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,130,735.11

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	-222,538,546.01
——股票投资	-222,538,546.01
——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	-222,538,546.01

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	4,562,399.10
转换费收入	257,053.76
合计	4,819,452.86

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。

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	4,127,875.10
银行间市场交易费用	-
合计	4,127,875.10

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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
划款手续费	11,386.67

帐户维护费	16,700.00
其他费用	300.00
合计	221,783.36

注：其他费用为银行手续费。

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（简称“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
长江证券	75,490,597.57	2.20%	57,022,069.45	7.66%

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：本基金本报告期及上年度可比期间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：本基金本报告期及上年度可比期间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	70,304.49	3.50%	62,290.82	8.70%
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
长江证券	48,901.81	7.89%	11,764.06	3.45%

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。

6.4.9.1.6 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	27,800,249.10
其中：支付销售机构的客户维护费	6,794,131.01	883,799.34

注：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 1.50% 的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.9.1.7 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,633,374.80	356,833.65

注：支付基金托管人中国建设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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期及上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.9.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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
交通银行股份有限公司	5,981,247.23	1,283,174.73	56,054,243.20	246,923.16

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2017年6月30日的相关余额为人民币770,000,000.00元。(2016年12月31日的相关余额为人民币441,988,463.83元。)

6.4.9.5 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。

6.4.9.6 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：本基金本报告期末进行利润分配。

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	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
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	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

		日	3日							
--	--	---	----	--	--	--	--	--	--	--

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
300209	天泽信息	2017年2月10日	拟筹划重大资产重组	25.08	-	-	2,448,880	64,483,996.34	61,417,910.40	-
300065	海兰信	2017年6月22日	拟筹划重大资产重组	25.63	2017年7月6日	23.07	2,332,539	58,202,946.87	59,782,974.57	-
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	-
002509	天广中茂	2017年6月12日	因刊登重要事项公告	9.20	-	-	192	1,214.52	1,766.40	-
603238	诺邦股份	2017年6月7日	拟筹划重大资产重组	29.38	-	-	50	665.50	1,469.00	-
300098	高新兴	2017年6月22日	因刊登重要事项公告	12.90	2017年7月3日	13.18	23	331.65	296.70	-

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	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	5,981,247.23	-	-	-	-	5,981,247.23
结算备付金	770,459,910.07	-	-	-	-	770,459,910.07
存出保证金	448,048.79	-	-	-	-	448,048.79
交易性金融资产	-	-	-	-	2,834,183,986.11	2,834,183,986.11
应收利息	-	-	-	-	212,238.47	212,238.47
应收申购款	-	-	-	-	1,309,854.80	1,309,854.80
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	776,889,206.09	-	-	-	2,835,706,079.38	3,612,595,285.47
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	138,146,793.71	138,146,793.71
应付赎回款	-	-	-	-	4,235,007.36	4,235,007.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,945,305.31	3,945,305.31
应付托管费	-	-	-	-	657,550.88	657,550.88
应付交易费用	-	-	-	-	715,985.36	715,985.36
其他负债	-	-	-	-	275,357.68	275,357.68
负债总计	-	-	-	-	147,976,000.30	147,976,000.30
利率敏感度缺口	776,889,206.09	-	-	-	2,687,730,079.08	3,464,619,285.17
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	218,698,050.57	-	-	-	-	218,698,050.57
结算备付金	441,988,463.83	-	-	-	-	441,988,463.83
存出保证金	839,852.14	-	-	-	-	839,852.14
交易性金融资产	-	-	-	-	3,335,433,370.40	3,335,433,370.40
应收利息	-	-	-	-	254,231.50	254,231.50
应收申购款	-	-	-	-	15,823,688.32	15,823,688.32
资产总计	661,526,366.54	-	-	-	3,351,511,290.22	4,013,037,656.76
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	16,681,263.72	16,681,263.72
应付赎回款	-	-	-	-	12,008,551.52	12,008,551.52

应付管理人报酬	-	-	-	-	5,040,530.25	5,040,530.25
应付托管费	-	-	-	-	840,088.38	840,088.38
应付交易费用	-	-	-	-	3,960,254.72	3,960,254.72
其他负债	-	-	-	-	409,140.70	409,140.70
负债总计	-	-	-	-	38,939,829.29	38,939,829.29
利率敏感度缺口	661,526,366.54	-	-	-	3,312,571,460.93	3,974,097,827.47

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

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 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	2,834,183,986.11	81.80	3,335,433,370.40	83.93
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	2,834,183,986.11	81.80	3,335,433,370.40	83.93

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 1.63%（2016年12月31日 VaR 值为 3.07%）	-56,422,371.37	-122,004,803.30

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	2,712,786,495.59	121,397,490.52	-	2,834,183,986.11
债券投资	-	-	-	-
合计	2,712,786,495.59	121,397,490.52	-	2,834,183,986.11

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	2,834,183,986.11	78.45
	其中：股票	2,834,183,986.11	78.45
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	776,441,157.30	21.49
7	其他各项资产	1,970,142.06	0.05
8	合计	3,612,595,285.47	100.00

注：本基金本报告期末未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	109,520,203.57	3.16
B	采矿业	14,066,417.70	0.41
C	制造业	2,235,290,427.24	64.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,246,590.94	3.15
E	建筑业	58,476,231.94	1.69
F	批发和零售业	87,921,590.82	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	5,718,051.77	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	155,095,510.62	4.48
J	金融业	18,358.50	0.00
K	房地产业	11,274,106.55	0.33
L	租赁和商务服务业	6,260,459.12	0.18

M	科学研究和技术服务业	3,850,189.06	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	90,961.93	0.00
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	7,657,986.19	0.22
S	综合	29,696,900.16	0.86
	合计	2,834,183,986.11	81.80

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	300138	晨光生物	6,142,882	80,594,611.84	2.33
2	002472	双环传动	7,272,608	79,780,509.76	2.30
3	600589	广东榕泰	9,924,837	72,550,558.47	2.09
4	300326	凯利泰	7,530,041	70,707,084.99	2.04
5	300303	聚飞光电	16,059,778	69,538,838.74	2.01
6	300079	数码视讯	11,482,984	67,175,456.40	1.94
7	002604	龙力生物	7,159,095	66,651,174.45	1.92
8	002593	日上集团	11,880,602	62,491,966.52	1.80
9	300209	天泽信息	2,448,880	61,417,910.40	1.77
10	000938	紫光股份	1,000,096	61,125,867.52	1.76
11	300065	海兰信	2,332,539	59,782,974.57	1.73
12	002139	拓邦股份	5,550,258	59,776,278.66	1.73
13	002218	拓日新能	5,996,455	58,405,471.70	1.69
14	300335	迪森股份	2,950,674	56,564,420.58	1.63
15	002321	华英农业	5,046,065	55,405,793.70	1.60
16	002674	兴业科技	4,200,028	52,752,351.68	1.52
17	300294	博雅生物	1,248,987	51,508,223.88	1.49
18	002118	紫鑫药业	7,405,410	50,578,950.30	1.46
19	002661	克明面业	3,115,735	50,568,379.05	1.46
20	300143	星河生物	1,820,031	50,323,857.15	1.45
21	002370	亚太药业	1,660,665	48,690,697.80	1.41
22	002529	海源机械	2,752,448	48,167,840.00	1.39

23	300048	合康新能	9,100,091	47,775,477.75	1.38
24	300035	中科电气	5,700,038	46,740,311.60	1.35
25	002403	爱仕达	3,484,279	45,922,797.22	1.33
26	002365	永安药业	1,500,014	45,390,423.64	1.31
27	600461	洪城水业	6,255,366	45,101,188.86	1.30
28	300287	飞利信	4,784,624	43,922,848.32	1.27
29	300241	瑞丰光电	3,430,049	43,836,026.22	1.27
30	300141	和顺电气	3,500,003	43,610,037.38	1.26
31	300306	远方光电	2,500,008	43,325,138.64	1.25
32	002452	长高集团	6,298,873	43,273,257.51	1.25
33	300158	振东制药	2,666,596	43,252,187.12	1.25
34	002438	江苏神通	5,089,846	42,805,604.86	1.24
35	300031	宝通科技	2,285,090	42,022,805.10	1.21
36	002637	赞宇科技	3,874,327	41,455,298.90	1.20
37	300194	福安药业	5,915,395	41,111,995.25	1.19
38	300262	巴安水务	2,679,430	40,700,541.70	1.17
39	600429	三元股份	6,130,670	40,033,275.10	1.16
40	000705	浙江震元	3,852,276	39,678,442.80	1.15
41	002193	如意集团	2,682,319	39,430,089.30	1.14
42	300283	温州宏丰	5,086,669	36,725,750.18	1.06
43	000766	通化金马	2,200,013	35,156,207.74	1.01
44	300112	万讯自控	3,006,707	34,968,002.41	1.01
45	600178	东安动力	3,591,815	34,409,587.70	0.99
46	000551	创元科技	3,200,097	29,696,900.16	0.86
47	002680	长生生物	1,880,045	28,745,888.05	0.83
48	600090	同济堂	2,695,272	25,254,698.64	0.73
49	002079	苏州固锝	3,369,224	24,831,180.88	0.72
50	601996	丰林集团	5,368,102	23,082,838.60	0.67
51	300162	雷曼股份	1,600,029	16,848,305.37	0.49
52	300040	九洲电气	1,203,722	12,205,741.08	0.35
53	002497	雅化集团	800,030	7,760,291.00	0.22
54	300349	金卡智能	260,681	7,278,213.52	0.21
55	600960	渤海活塞	693,429	5,290,863.27	0.15
56	300233	金城医药	251,257	5,273,884.43	0.15
57	002383	合众思壮	291,400	4,566,238.00	0.13
58	000635	英力特	253,000	4,288,350.00	0.12
59	300184	力源信息	342,900	4,265,676.00	0.12
60	002295	精艺股份	305,421	4,239,243.48	0.12
61	600302	标准股份	507,400	4,211,420.00	0.12

62	601600	中国铝业	931,400	4,209,928.00	0.12
63	300061	康耐特	226,600	4,173,972.00	0.12
64	000637	茂化实华	613,001	4,070,326.64	0.12
65	002380	科远股份	219,846	4,056,158.70	0.12
66	300227	光韵达	184,000	3,990,960.00	0.12
67	002632	道明光学	503,800	3,990,096.00	0.12
68	000949	新乡化纤	862,800	3,986,136.00	0.12
69	300120	经纬电材	302,123	3,969,896.22	0.11
70	002645	华宏科技	222,687	3,968,282.34	0.11
71	300238	冠昊生物	155,600	3,944,460.00	0.11
72	300193	佳士科技	469,642	3,902,725.02	0.11
73	300046	台基股份	208,226	3,893,826.20	0.11
74	603128	华贸物流	453,052	3,878,125.12	0.11
75	000761	本钢板材	739,410	3,867,114.30	0.11
76	002376	新北洋	281,400	3,860,808.00	0.11
77	002582	好想你	321,000	3,858,420.00	0.11
78	002483	润邦股份	585,246	3,856,771.14	0.11
79	300360	炬华科技	255,300	3,842,265.00	0.11
80	601899	紫金矿业	1,119,800	3,840,914.00	0.11
81	600723	首商股份	430,500	3,840,060.00	0.11
82	000415	渤海金控	570,400	3,838,792.00	0.11
83	300286	安科瑞	186,025	3,837,695.75	0.11
84	000030	富奥股份	429,100	3,836,154.00	0.11
85	601678	滨化股份	551,600	3,833,620.00	0.11
86	002527	新时达	360,235	3,829,298.05	0.11
87	002595	豪迈科技	172,211	3,828,250.53	0.11
88	002394	联发股份	259,800	3,826,854.00	0.11
89	002662	京威股份	531,400	3,826,080.00	0.11
90	002454	松芝股份	303,600	3,825,360.00	0.11
91	002003	伟星股份	365,800	3,822,610.00	0.11
92	000719	大地传媒	366,400	3,821,552.00	0.11
93	002293	罗莱生活	333,164	3,818,059.44	0.11
94	002398	建研集团	296,773	3,816,500.78	0.11
95	600051	宁波联合	399,160	3,815,969.60	0.11
96	600499	科达洁能	480,303	3,813,605.82	0.11
97	002550	千红制药	641,862	3,812,660.28	0.11
98	000417	合肥百货	461,400	3,806,550.00	0.11
99	601567	三星医疗	365,216	3,805,550.72	0.11
100	000739	普洛药业	518,300	3,804,322.00	0.11

101	002479	富春环保	319,633	3,803,632.70	0.11
102	002081	金螳螂	346,400	3,803,472.00	0.11
103	600105	永鼎股份	471,200	3,802,584.00	0.11
104	600327	大东方	464,285	3,802,494.15	0.11
105	601339	百隆东方	638,900	3,801,455.00	0.11
106	600081	东风科技	305,200	3,799,740.00	0.11
107	002713	东易日盛	186,460	3,798,190.20	0.11
108	002775	文科园林	187,472	3,798,182.72	0.11
109	601179	中国西电	683,100	3,798,036.00	0.11
110	601515	东风股份	335,873	3,795,364.90	0.11
111	002002	鸿达兴业	484,300	3,792,069.00	0.11
112	300498	温氏股份	161,713	3,790,552.72	0.11
113	600565	迪马股份	687,039	3,785,584.89	0.11
114	002706	良信电器	318,500	3,783,780.00	0.11
115	601137	博威合金	332,919	3,781,959.84	0.11
116	000541	佛山照明	415,060	3,781,196.60	0.11
117	600261	阳光照明	575,301	3,779,727.57	0.11
118	601928	凤凰传媒	387,263	3,779,686.88	0.11
119	002133	广宇集团	682,179	3,779,271.66	0.11
120	300204	舒泰神	242,300	3,777,457.00	0.11
121	600642	申能股份	599,500	3,776,850.00	0.11
122	002534	杭锅股份	398,200	3,766,972.00	0.11
123	002315	焦点科技	151,000	3,765,940.00	0.11
124	002354	天神娱乐	175,100	3,764,650.00	0.11
125	601877	正泰电器	186,900	3,754,821.00	0.11
126	000065	北方国际	156,300	3,716,814.00	0.11
127	601238	广汽集团	142,300	3,708,338.00	0.11
128	300341	麦迪电气	422,018	3,650,455.70	0.11
129	002152	广电运通	357,883	2,974,007.73	0.09
130	000688	建新矿业	339,000	2,712,000.00	0.08
131	300165	天瑞仪器	305,800	2,507,560.00	0.07
132	002612	朗姿股份	181,600	2,458,864.00	0.07
133	002026	山东威达	263,400	2,389,038.00	0.07
134	601117	中国化学	341,000	2,383,590.00	0.07
135	002440	闰土股份	156,100	2,382,086.00	0.07
136	002554	惠博普	403,400	2,380,060.00	0.07
137	002188	巴士在线	92,600	2,379,820.00	0.07
138	002521	齐峰新材	240,800	2,379,104.00	0.07
139	002367	康力电梯	203,400	2,375,712.00	0.07

140	601677	明泰铝业	172,800	2,356,992.00	0.07
141	000789	万年青	330,500	2,343,245.00	0.07
142	002222	福晶科技	162,600	2,320,302.00	0.07
143	600067	冠城大通	318,400	2,187,408.00	0.06
144	000951	中国重汽	121,800	1,862,322.00	0.05
145	600966	博汇纸业	339,700	1,763,043.00	0.05
146	600308	华泰股份	309,900	1,760,232.00	0.05
147	300328	宜安科技	156,900	1,741,590.00	0.05
148	600971	恒源煤电	213,700	1,737,381.00	0.05
149	300099	精准信息	176,800	1,695,512.00	0.05
150	600348	阳泉煤业	248,500	1,684,830.00	0.05
151	000552	靖远煤电	464,500	1,658,265.00	0.05
152	300342	天银机电	107,100	1,634,346.00	0.05
153	002515	金字火腿	169,400	1,605,912.00	0.05
154	600585	海螺水泥	70,200	1,595,646.00	0.05
155	600180	瑞茂通	112,917	1,585,354.68	0.05
156	000709	河钢股份	377,400	1,581,306.00	0.05
157	002247	帝龙文化	120,000	1,574,400.00	0.05
158	601006	大秦铁路	186,900	1,568,091.00	0.05
159	601965	中国汽研	165,500	1,554,045.00	0.04
160	000919	金陵药业	142,846	1,545,593.72	0.04
161	600335	国机汽车	128,702	1,539,275.92	0.04
162	000718	苏宁环球	259,700	1,521,842.00	0.04
163	601228	广州港	31,511	271,624.82	0.01
164	603833	欧派家居	2,129	233,891.94	0.01
165	601952	苏垦农发	10,425	144,594.75	0.00
166	300618	寒锐钴业	1,500	141,450.00	0.00
167	601366	利群股份	8,400	116,760.00	0.00
168	300625	三雄极光	3,534	115,915.20	0.00
169	002867	周大生	3,444	106,350.72	0.00
170	002859	洁美科技	1,433	104,609.00	0.00
171	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.00
172	603345	安井食品	3,227	82,611.20	0.00
173	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.00
174	603133	碳元科技	2,345	78,698.20	0.00
175	603717	天域生态	2,390	77,937.90	0.00
176	300641	正丹股份	4,020	77,586.00	0.00
177	603517	绝味食品	2,225	77,585.75	0.00
178	300623	捷捷微电	1,142	76,742.40	0.00

179	603303	得邦照明	2,292	76,529.88	0.00
180	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
181	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.00
182	002872	天圣制药	2,003	74,050.91	0.00
183	603385	惠达卫浴	2,650	70,993.50	0.00
184	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.00
185	300627	华测导航	1,498	69,806.80	0.00
186	603586	金麒麟	2,046	69,666.30	0.00
187	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.00
188	603768	常青股份	2,455	62,455.20	0.00
189	603906	龙蟠科技	2,716	61,300.12	0.00
190	603179	新泉股份	1,395	61,254.45	0.00
191	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.00
192	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.00
193	603138	海量数据	1,295	57,601.60	0.00
194	002869	金溢科技	1,255	54,592.50	0.00
195	603896	寿仙谷	1,392	54,301.92	0.00
196	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.00
197	300630	普利制药	1,488	53,716.80	0.00
198	603505	金石资源	2,570	52,967.70	0.00
199	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.00
200	603955	大千生态	1,150	51,382.00	0.00
201	002861	瀛通通讯	1,664	51,201.28	0.00
202	002855	捷荣技术	2,956	50,724.96	0.00
203	603903	中持股份	1,031	49,271.49	0.00
204	603081	大丰实业	2,582	49,006.36	0.00
205	603050	科林电气	1,256	48,933.76	0.00
206	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	0.00
207	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
208	002774	快意电梯	3,341	46,774.00	0.00
209	603178	圣龙股份	2,478	45,991.68	0.00
210	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
211	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.00
212	300639	凯普生物	1,046	44,894.32	0.00
213	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
214	300633	开立医疗	2,324	43,272.88	0.00
215	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.00
216	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
217	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.00

218	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.00
219	603797	联泰环保	2,137	40,688.48	0.00
220	002850	科达利	448	40,673.92	0.00
221	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
222	002866	传艺科技	1,488	40,071.84	0.00
223	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.00
224	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.00
225	002860	星帅尔	777	37,995.30	0.00
226	002865	钧达股份	1,246	36,881.60	0.00
227	603926	铁流股份	1,082	36,712.26	0.00
228	002863	今飞凯达	2,249	36,343.84	0.00
229	002877	智能自控	1,436	36,302.08	0.00
230	603787	新日股份	1,850	36,204.50	0.00
231	603383	顶点软件	811	36,138.16	0.00
232	002856	美芝股份	1,130	36,001.80	0.00
233	603811	诚意药业	953	35,918.57	0.00
234	300622	博士眼镜	1,180	35,907.40	0.00
235	002868	绿康生化	1,234	35,872.38	0.00
236	300621	维业股份	1,658	35,713.32	0.00
237	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
238	300626	华瑞股份	1,208	35,140.72	0.00
239	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.00
240	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.00
241	300620	光库科技	986	34,095.88	0.00
242	603320	迪贝电气	958	34,066.48	0.00
243	603388	元成股份	892	33,512.44	0.00
244	603538	美诺华	1,122	33,480.48	0.00
245	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
246	300643	万通智控	2,026	33,165.62	0.00
247	603196	日播时尚	2,083	32,682.27	0.00
248	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.00
249	603496	恒为科技	912	31,354.56	0.00
250	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.00
251	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.00
252	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
253	300603	立昂技术	934	30,616.52	0.00
254	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.00
255	300637	扬帆新材	1,312	30,595.84	0.00
256	300635	达安股份	949	30,178.20	0.00

257	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
258	300632	光莆股份	1,237	29,811.70	0.00
259	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
260	300514	友讯达	1,024	27,535.36	0.00
261	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.00
262	300659	中孚信息	776	27,175.52	0.00
263	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
264	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	0.00
265	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
266	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
267	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.00
268	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
269	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
270	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
271	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
272	002839	张家港行	1,152	18,109.44	0.00
273	002845	同兴达	248	17,806.40	0.00
274	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
275	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
276	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
277	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
278	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
279	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
280	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
281	300616	尚品宅配	58	7,862.48	0.00
282	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
283	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
284	002852	道道全	71	5,396.00	0.00
285	300526	中潜股份	168	5,243.28	0.00
286	603986	兆易创新	66	5,135.46	0.00
287	603165	荣晟环保	67	4,445.45	0.00
288	603881	数据港	77	3,759.14	0.00
289	603637	镇海股份	112	3,510.08	0.00
290	603358	华达科技	69	3,495.54	0.00
291	603665	康隆达	85	3,412.75	0.00
292	300610	晨化股份	144	3,379.68	0.00
293	002846	英联股份	92	3,201.60	0.00
294	603630	拉芳家化	85	3,163.70	0.00
295	300588	熙菱信息	80	2,783.20	0.00

296	603089	正裕工业	87	2,604.78	0.00
297	002849	威星智能	60	2,562.00	0.00
298	002843	泰嘉股份	77	2,291.52	0.00
299	603929	亚翔集成	93	2,094.36	0.00
300	603966	法兰泰克	90	2,068.20	0.00
301	300580	贝斯特	89	2,011.40	0.00
302	002253	川大智胜	82	1,968.00	0.00
303	300592	华凯创意	83	1,923.11	0.00
304	002847	盐津铺子	53	1,918.60	0.00
305	603578	三星新材	42	1,918.14	0.00
306	603628	清源股份	81	1,806.30	0.00
307	002509	天广中茂	192	1,766.40	0.00
308	300591	万里马	126	1,726.20	0.00
309	300596	利安隆	69	1,487.64	0.00
310	603238	诺邦股份	50	1,469.00	0.00
311	300600	瑞特股份	24	1,336.80	0.00
312	002842	翔鹭钨业	32	1,308.80	0.00
313	300609	汇纳科技	37	1,267.99	0.00
314	603839	安正时尚	40	1,084.80	0.00
315	601858	中国科传	80	1,001.60	0.00
316	300599	雄塑科技	55	973.50	0.00
317	603603	博天环境	21	881.58	0.00
318	300606	金太阳	28	868.28	0.00
319	300597	吉大通信	46	789.36	0.00
320	002390	信邦制药	81	705.51	0.00
321	300605	恒锋信息	16	508.80	0.00
322	300593	新雷能	19	501.41	0.00
323	603817	海峡环保	29	498.80	0.00
324	601212	白银有色	58	472.12	0.00
325	002374	丽鹏股份	80	470.40	0.00
326	300589	江龙船艇	19	466.64	0.00
327	002824	和胜股份	16	396.80	0.00
328	300256	星星科技	36	374.40	0.00
329	000636	风华高科	43	365.93	0.00
330	002840	华统股份	14	356.58	0.00
331	002851	麦格米特	8	318.96	0.00
332	603615	茶花股份	15	296.85	0.00
333	300098	高新兴	23	296.70	0.00
334	300601	康泰生物	9	252.54	0.00

335	601881	中国银河	21	249.06	0.00
336	000548	湖南投资	29	210.83	0.00
337	000978	桂林旅游	13	120.38	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	002604	龙力生物	105,991,109.71	2.67
2	300079	数码视讯	101,685,464.54	2.56
3	002674	兴业科技	94,067,959.10	2.37
4	300326	凯利泰	94,013,527.65	2.37
5	300143	星普医科	64,640,741.62	1.63
6	300112	万讯自控	61,704,517.13	1.55
7	002118	紫鑫药业	60,930,314.49	1.53
8	300262	巴安水务	58,806,980.29	1.48
9	002374	丽鹏股份	57,898,839.02	1.46
10	002680	长生生物	37,297,189.78	0.94
11	300162	雷曼股份	37,043,961.39	0.93
12	601996	丰林集团	36,776,080.23	0.93
13	300158	振东制药	36,519,226.99	0.92
14	600090	同济堂	36,036,952.62	0.91
15	002079	苏州固锝	35,610,686.00	0.90
16	300040	九洲电气	17,916,006.22	0.45
17	002472	双环传动	17,149,731.20	0.43
18	002365	永安药业	14,104,097.72	0.35
19	300209	天泽信息	12,576,324.71	0.32
20	002593	日上集团	12,572,366.96	0.32

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	002507	涪陵榨菜	100,645,859.88	2.53

2	002497	雅化集团	80,383,262.81	2.02
3	300262	巴安水务	76,433,225.90	1.92
4	002253	川大智胜	69,497,806.75	1.75
5	000636	风华高科	66,010,686.26	1.66
6	300046	台基股份	65,712,171.17	1.65
7	002585	双星新材	63,012,669.83	1.59
8	600178	东安动力	62,514,481.90	1.57
9	300193	佳士科技	61,402,044.98	1.55
10	000548	湖南投资	60,797,371.96	1.53
11	000978	桂林旅游	60,569,232.86	1.52
12	002390	信邦制药	60,384,907.02	1.52
13	002374	丽鹏股份	59,327,756.03	1.49
14	300256	星星科技	59,325,073.93	1.49
15	300194	福安药业	53,814,061.05	1.35
16	002321	华英农业	47,301,001.88	1.19
17	000004	国农科技	46,312,419.76	1.17
18	000705	浙江震元	44,726,989.25	1.13
19	300158	振东制药	41,160,266.72	1.04
20	002365	永安药业	35,938,088.01	0.90

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	1,614,065,719.14
卖出股票收入（成交）总额	1,817,785,314.14

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	448,048.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	212,238.47
5	应收申购款	1,309,854.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,970,142.06

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

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	300209	天泽信息	61,417,910.40	1.77	拟筹划重大资产重组

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

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
92,711	38,207.84	2,024,776,608.83	57.16%	1,517,510,805.79	42.84%

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	2,471,746.73	0.07%

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（2015年2月4日）基金份额总额	869,346,402.40
本报告期期初基金份额总额	3,693,082,074.66
本报告期基金总申购份额	1,472,498,398.75
减：本报告期基金总赎回份额	1,623,293,058.79
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	3,542,287,414.62

§ 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

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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	
海通证券	1	999,629,734.42	29.17%	531,105.70	26.48%	-
天风证券	1	954,506,647.33	27.85%	507,130.04	25.28%	-
华泰证券	2	640,728,890.00	18.69%	340,419.35	16.97%	-

兴业证券	2	215,408,936.39	6.29%	179,069.56	8.93%	-
广发证券	1	193,657,422.43	5.65%	160,986.98	8.02%	-
东北证券	1	131,195,538.41	3.83%	69,703.64	3.47%	-
爱建证券	1	109,206,122.64	3.19%	58,019.66	2.89%	-
光大证券	1	107,452,640.02	3.14%	89,325.36	4.45%	-
长江证券	2	75,490,597.57	2.20%	70,304.49	3.50%	-
广发证券退租	1					-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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。

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	长信量化中小盘股票型证券投资基金 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	长信基金管理有限责任公司关于增加国都证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年2月22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	长信量化中小盘股票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3月20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	长信量化中小盘股票型证券投资基金 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旗下部分	上证报、中证报、证	2017年3月30日

	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	券时报、公司网站	
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
18	长信量化中小盘股票型证券投资基金 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
19	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
20	长信基金管理有限责任公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（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 4 月 25 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、中国证监会批准长信量化中小盘股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化中小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化中小盘股票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