

长信量化先锋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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化先锋混合型证券投资基金	
基金简称	长信量化先锋混合	
基金主代码	519983	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 18 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	4,478,230,674.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
下属分级基金场内简称:	长信 LHA	-
下属分级基金的交易代码:	519983	004221
报告期末下属分级基金的份额总额	4,477,164,717.91 份	1,065,956.61 份

注：基金管理人决定自2017年1月9日起对长信量化先锋混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额，具体事宜可详见基金管理人于2017年1月4日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，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	本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险收益参数；二是通过自下而上的上市公司研究，借助长信行业多因素选股模型选取具有投资价值的上市公司股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	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、证券时报、证券日报
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
A 类注册登记机构	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
C 类注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月9日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-252,235,117.74	-129,192.10
本期利润	-1,045,060,990.55	-249,123.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2053	-0.2845
本期加权平均净值利润率	-11.53%	-17.73%
本期基金份额净值增长率	-12.32%	-13.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	1,211,865,535.30	486,514.25
期末可供分配基金份额利润	0.2707	0.4564
期末基金资产净值	6,945,392,700.56	1,552,470.86
期末基金份额净值	1.551	1.456
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	138.95%	-13.88%

注：1、长信量化先锋混合 C 份额增加日为 2017 年 1 月 9 日，截至本报告期末，长信量化先锋混合 C 份额运作时间未满足半年；

2、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。

3、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信量化先锋混合 A

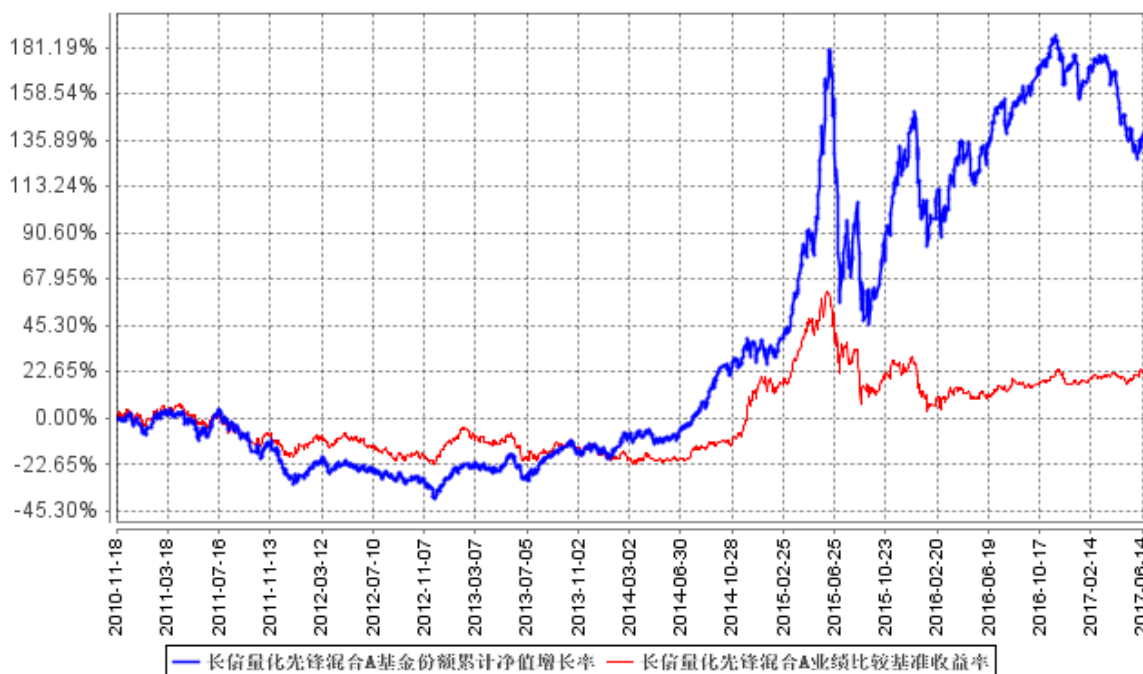
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.72%	0.96%	4.00%	0.51%	-1.28%	0.45%

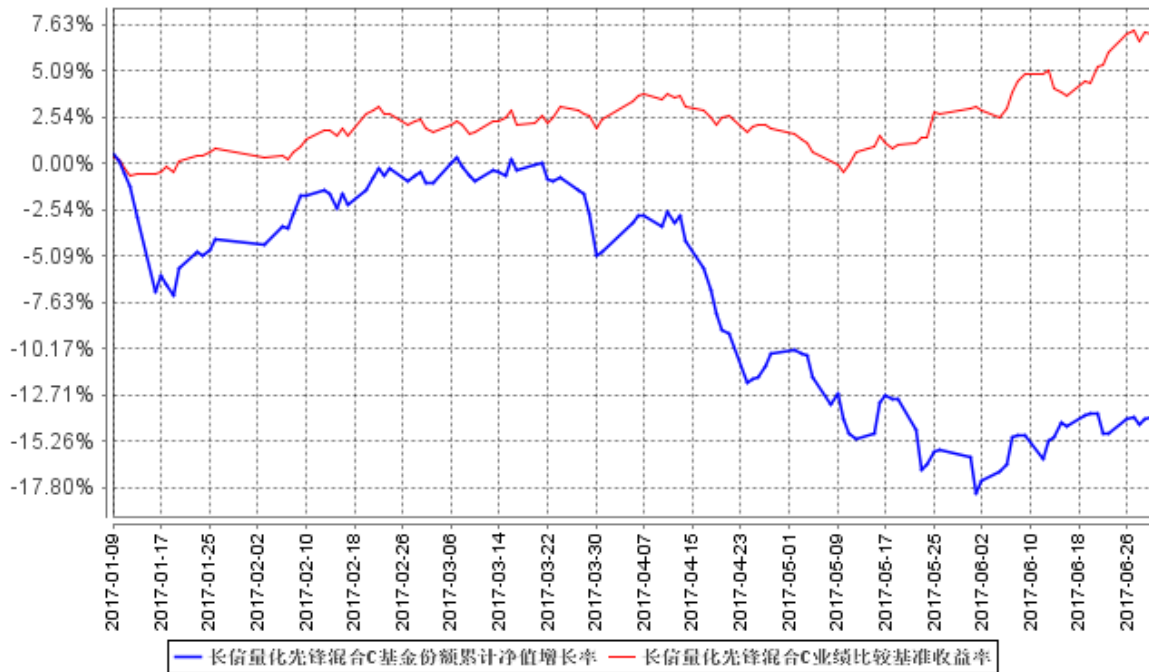
过去三个月	-9.19%	1.06%	4.63%	0.47%	-13.82%	0.59%
过去六个月	-12.32%	0.98%	8.05%	0.43%	-20.37%	0.55%
过去一年	-2.40%	0.95%	12.26%	0.51%	-14.66%	0.44%
过去三年	153.12%	1.95%	57.05%	1.31%	96.07%	0.64%
自基金合同生效起至今	138.95%	1.58%	25.86%	1.14%	113.09%	0.44%

长信量化先锋混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.61%	0.95%	4.00%	0.51%	-1.39%	0.44%
过去三个月	-9.45%	1.06%	4.63%	0.47%	-14.08%	0.59%
自份额增加日起至今 (2017年1月9日-2017年6月30日)	-13.88%	0.99%	7.14%	0.43%	-21.02%	0.56%

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、长信量化先锋混合 A 图示日期为 2010 年 11 月 18 日至 2017 年 6 月 30 日，长信量化先锋混合 C 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）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合规守信情况的说明

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，量化先锋 A 净值为 1.551，报告期内基金 A 类份额净值收益率为 -12.32%，同期业绩比较基准收益率为 8.05%。

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回调。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 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%。

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 A 类份额净值为 1.551 元，累计份额净值为 2.401 元；本基金 C 类份额净值为 1.456 元，累计份额净值为 1.756 元。本报告期内本基金 A 类净值增长率为 -12.32%，同期业绩比较基准收益率为 8.05%；本报告期内本基金 C 类净值增长率为 -13.88%，同期业绩比较基准涨幅 7.14%。

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。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，本基金本报告期已公告实施一次分红，符合基金合同中关于利润分配条款的约定。详细情况如下：

序号 (长信 量化先 锋混合 A)	权益登 记日	除息日	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2017 年 3 月 28 日	2017 年 3 月 28 日	2.000	635,772,437.23	340,799,886.56	976,572,323.79
合计			2.000	635,772,437.23	340,799,886.56	976,572,323.79
序号 (长信 量化先 锋混合 C)	权益登 记日	除息日	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2017 年 3 月 28 日	2017 年 3 月 28 日	3.000	129,163.73	143,027.38	272,191.11
合计			3.000	129,163.73	143,027.38	272,191.11

本基金收益分配原则如下：

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 6 次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 30%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配（可

供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数)；

- 4、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净额后不能低于面值；
- 5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；
- 6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。
- 7、法律法规或监管机构另有规定的，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先锋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 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋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。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 976,844,514.90 元，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先锋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：长信量化先锋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	499,161,306.28	485,314.65
结算备付金		847,815,354.86	1,732,162,090.02
存出保证金		1,627,643.39	1,710,316.39
交易性金融资产	6.4.6.2	5,712,619,266.09	9,259,574,241.32
其中：股票投资		5,712,619,266.09	9,259,574,241.32
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	650,166.66	617,970.57
应收股利		-	-
应收申购款		5,166,975.54	22,401,661.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		7,067,040,712.82	11,016,951,593.99
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		77,709,356.58	9,728,946.10
应付赎回款		28,732,189.41	36,783,465.03
应付管理人报酬		8,551,960.22	13,929,393.27
应付托管费		1,425,326.71	2,321,565.54
应付销售服务费		1,406.67	-
应付交易费用	6.4.6.7	3,204,096.22	9,600,986.61

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	471,205.59	511,976.57
负债合计		120,095,541.40	72,876,333.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	4,478,230,674.52	5,557,393,335.62
未分配利润	6.4.6.10	2,468,714,496.90	5,386,681,925.25
所有者权益合计		6,946,945,171.42	10,944,075,260.87
负债和所有者权益总计		7,067,040,712.82	11,016,951,593.99

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长信量化先锋混合 A 份额净值 1.551 元，份额总额 4,477,164,717.91 份，长信量化先锋混合 C 份额净值 1.456 元，份额总额 1,065,956.61 份。

6.2 利润表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-946,683,762.03	254,571,192.75
1.利息收入		12,422,042.80	5,107,439.06
其中：存款利息收入	6.4.6.11	12,242,245.35	4,938,154.98
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		179,797.45	169,284.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-173,572,037.75	351,822,562.09
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-198,853,908.74	341,757,370.15
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	25,281,870.99	10,065,191.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-792,945,804.20	-104,138,980.53
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	7,412,037.12	1,780,172.13
减：二、费用		98,626,352.01	39,137,090.18
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	67,746,502.50	23,950,374.83
2. 托管费	6.4.9.2.2	11,291,083.74	3,991,729.18
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	6,586.39	-
4. 交易费用	6.4.6.19	19,366,236.32	11,027,603.22
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	215,943.06	167,382.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,045,310,114.04	215,434,102.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,045,310,114.04	215,434,102.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化先锋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）	5,557,393,335.62	5,386,681,925.25	10,944,075,260.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,045,310,114.04	-1,045,310,114.04
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）	-1,079,162,661.10	-895,812,799.41	-1,974,975,460.51
其中：1.基金申购款	2,557,135,304.29	2,174,840,287.75	4,731,975,592.04
2.基金赎回款	-3,636,297,965.39	-3,070,653,087.16	-6,706,951,052.55
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）	-	-976,844,514.90	-976,844,514.90

五、期末所有者权益 (基金净值)	4,478,230,674.52	2,468,714,496.90	6,946,945,171.42
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)	1,058,960,844.72	1,552,804,932.52	2,611,765,777.24
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	215,434,102.57	215,434,102.57
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)	1,159,688,323.78	994,222,897.21	2,153,911,220.99
其中：1.基金申购款	1,996,955,327.53	1,820,651,357.02	3,817,606,684.55
2.基金赎回款	-837,267,003.75	-826,428,459.81	-1,663,695,463.56
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)	-	-365,147,809.41	-365,147,809.41
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,218,649,168.50	2,397,314,122.89	4,615,963,291.39

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

长信量化先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信量化先锋股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2010】962号文)批准,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《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年11月18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”)。

本基金于 2010 年 10 月 11 日至 2010 年 11 月 12 日募集,募集资金总额人民币 324,510,451.15 元,利息转份额人民币 161,246.27 元,募集规模为 324,671,697.42 份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证,并出具了沪众会字(2010)第 4128 号验资报告。

2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金,关于更名的事宜,我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》和《长信量化先锋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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%,权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%,债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的 5%-40%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的 80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:沪深 300 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公告[2010]5号《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 日到 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	499,161,306.28
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	499,161,306.28

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	6,534,263,714.12	5,712,619,266.09	-821,644,448.03
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	6,534,263,714.12	5,712,619,266.09	-821,644,448.03

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	1,908.54
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	647,596.03
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.84
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	659.25
合计	650,166.66

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	3,204,096.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,204,096.22

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	103,308.90
预提费用	-
预提信息披露费-中证报	49,588.57
预提信息披露费-证券时报	149,588.57
预提账户维护费	4,500.00
预提信息披露费-证券日报	44,630.98
预提审计费	119,588.57
合计	471,205.59

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信量化先锋混合 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,557,393,335.62	5,557,393,335.62
本期申购	2,555,680,278.24	2,555,680,278.24
本期赎回(以“-”号填列)	-3,635,908,895.95	-3,635,908,895.95
- 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	4,477,164,717.91	4,477,164,717.91

金额单位：人民币元

长信量化先锋混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 9 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,455,026.05	1,455,026.05
本期赎回(以“-”号填列)	-389,069.44	-389,069.44
- 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	1,065,956.61	1,065,956.61

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信量化先锋混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,992,177,537.22	2,394,504,388.03	5,386,681,925.25
本期利润	-252,235,117.74	-792,825,872.81	-1,045,060,990.55
本期基金份额交易产生的变动数	-551,504,560.39	-345,316,067.87	-896,820,628.26
其中：基金申购款	1,292,946,051.60	880,680,248.01	2,173,626,299.61
基金赎回款	-1,844,450,611.99	-1,225,996,315.88	-3,070,446,927.87
本期已分配利润	-976,572,323.79	-	-976,572,323.79
本期末	1,211,865,535.30	1,256,362,447.35	2,468,227,982.65

单位：人民币元

长信量化先锋混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-129,192.10	-119,931.39	-249,123.49
本期基金份额交易产生的变动数	1,046,787.15	-38,958.30	1,007,828.85
其中：基金申购款	1,328,095.26	-114,107.12	1,213,988.14
基金赎回款	-281,308.11	75,148.82	-206,159.29
本期已分配利润	-272,191.11	-	-272,191.11
本期末	645,403.94	-158,889.69	486,514.25

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	455,464.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	44,508.57
结算备付金利息收入	11,727,420.56
其他	14,851.36
合计	12,242,245.35

注：其他为保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,405,445,526.44
减：卖出股票成本总额	8,604,299,435.18
买卖股票差价收入	-198,853,908.74

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	25,281,870.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,281,870.99

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	-792,945,804.20
——股票投资	-792,945,804.20
——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	-792,945,804.20

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	6,618,913.38
转换费收入	793,123.74
合计	7,412,037.12

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

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	19,366,236.32
银行间市场交易费用	-
合计	19,366,236.32

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	49,588.57
信息披露费	143,808.12
帐户维护费	15,000.00
其他费用	7,546.37
合计	215,943.06

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（“长江证券”）	基金管理人的股东
长信财通财汇 1 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

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	2,465,226,072.90	17.31%	3,942,578,246.29	48.54%

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长江证券	2,101,783.59	21.67%	53,220.03	1.66%
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	3,461,008.74	49.31%	2,817,180.07	61.34%

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。

6.4.9.2 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	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管理费	67,746,502.50	23,950,374.83
其中：支付销售机构的客户维护费	19,008,263.02	4,930,083.62

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 1.5%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.9.2.2 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	11,291,083.74	3,991,729.18

注：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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C	合计

长信基金管理有限责任公司	-	3,499.45	3,499.45
合计	-	3,499.45	3,499.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金于 2017 年 1 月 4 日发布了《长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》，自 2017 年 1 月 9 日起原有份额归为 A 类份额，同时增设 C 类份额。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费率为年费率 1.00%。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

长信量化先锋混合 A				
关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
长信-财通财 汇 1 号资产管	-	-	883,296.04	0.02%

理计划				
-----	--	--	--	--

注：1、长信-财通财汇 1 号资产管理计划为本基金管理人管理的资产管理计划。

2、本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	499,161,306.28	455,464.86	146,478.69	981,544.48

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 847,550,000.00 元（2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,732,162,090.02 元）。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 利润分配情况

长信量化先锋混合 A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017 年 3 月 28 日	2017 年 3 月 28 日	2.000	635,772,437.23	340,799,886.56	976,572,323.79	
合计	-	-	2.000	635,772,437.23	340,799,886.56	976,572,323.79	

长信量化先锋混合 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
----	-------	-----	-----------------------	--------------	---------------	------------------	----

1	2017年3月28日	2017年3月28日	3.000	129,163.73	143,027.38	272,191.11	
合计	-	-	3.000	129,163.73	143,027.38	272,191.11	

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
000032	深桑达A	2017年2月27日	拟筹划重大资产重组	15.69	-	-	5,773,667	89,314,791.27	90,588,835.23	-
002076	雪莱特	2017年6月2日	拟筹划重大资产重组	7.07	-	-	11,754,800	86,123,047.32	83,106,436.00	-
000700	模塑科技	2017年6月28日	因刊登重要事项公告	8.09	2017-8-16	8.00	8,000,097	72,159,507.87	64,720,784.73	-
300298	三诺生物	2017年5月22日	拟筹划重大资产重组	16.27	2017-07-17	16.09	3,840,044	59,473,830.80	62,477,515.88	-
300092	科新机电	2017年4月14日	拟筹划重大资产重组	12.70	-	-	4,890,915	69,160,485.44	62,114,620.50	-
002693	双成药业	2017年5月25日	拟筹划重大资产重组	6.67	2017-7-25	6.88	6,800,035	71,304,737.17	45,356,233.45	-
300030	阳普医疗	2017年5月16日	拟筹划重大资产重组	11.62	2017-8-15	11.62	3,811,053	53,815,094.28	44,284,435.86	-
600462	九有股份	2017年3月24日	拟筹划重大资产重组	8.14	2017-7-19	7.33	5,375,629	43,937,902.09	43,757,620.06	-
002417	三元达	2017年3月15日	拟筹划重大资产重组	15.50	2017-8-1	13.95	2,793,323	43,487,013.16	43,296,506.50	-
600193	创兴资源	2017年6月1日	拟筹划重大资产重组	6.77	-	-	6,000,048	68,527,930.29	40,620,324.96	-

002006	精功科技	2017年5月22日	拟筹划重大资产重组	7.91	-	-	634,118	6,414,000.85	5,015,873.38	-
601313	江南嘉捷	2017年6月13日	拟筹划重大资产重组	8.79	-	-	62,700	607,817.05	551,133.00	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	拟筹划重大资产重组	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-
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	-
603238	诺邦股份	2017年5月16日	拟筹划重大资产重组	29.38	-	-	50	665.50	1,469.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以

实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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同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	499,161,306.28	-	-	-	-	499,161,306.28
结算备付金	847,815,354.86	-	-	-	-	847,815,354.86

存出保证金	1,627,643.39	-	-	-	-	1,627,643.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-5,712,619,266.09	5,712,619,266.09
应收利息	-	-	-	-	650,166.66	650,166.66
应收申购款	11,930.43	-	-	-	5,155,045.11	5,166,975.54
资产总计	1,348,616,234.96	-	-	-	-5,718,424,477.86	7,067,040,712.82
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	77,709,356.58	77,709,356.58
应付赎回款	-	-	-	-	28,732,189.41	28,732,189.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,551,960.22	8,551,960.22
应付托管费	-	-	-	-	1,425,326.71	1,425,326.71
应付销售服务费	-	-	-	-	1,406.67	1,406.67
应付交易费用	-	-	-	-	3,204,096.22	3,204,096.22
其他负债	-	-	-	-	471,205.59	471,205.59
负债总计	-	-	-	-	120,095,541.40	120,095,541.40
利率敏感度缺口	1,348,616,234.96	-	-	-	-5,598,328,936.46	6,946,945,171.42
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	485,314.65	-	-	-	-	485,314.65
结算备付金	1,732,162,090.02	-	-	-	-	1,732,162,090.02
存出保证金	1,710,316.39	-	-	-	-	1,710,316.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-9,259,574,241.32	9,259,574,241.32
应收利息	-	-	-	-	617,970.57	617,970.57
应收申购款	-	-	-	-	22,401,661.04	22,401,661.04
资产总计	1,734,357,721.06	-	-	-	-9,282,593,872.93	11,016,951,593.99
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	9,728,946.10	9,728,946.10
应付赎回款	-	-	-	-	36,783,465.03	36,783,465.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	13,929,393.27	13,929,393.27
应付托管费	-	-	-	-	2,321,565.54	2,321,565.54
应付交易费用	-	-	-	-	9,600,986.61	9,600,986.61
其他负债	-	-	-	-	511,976.57	511,976.57
负债总计	-	-	-	-	72,876,333.12	72,876,333.12
利率敏感度缺口	1,734,357,721.06	-	-	-	-9,209,717,539.81	10,944,075,260.87

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。

银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他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	5,712,619,266.09	82.23	9,259,574,241.32	84.61
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	5,712,619,266.09	82.23	9,259,574,241.32	84.61

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 1.79%（2016 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.10%）	-124,386,067.06

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	5,126,531,218.09	586,088,048.00	-	5,712,619,266.09
债券投资	-	-	-	-
合计	5,126,531,218.09	586,088,048.00	-	5,712,619,266.09

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	5,712,619,266.09	80.83
	其中：股票	5,712,619,266.09	80.83
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	1,346,976,661.14	19.06
7	其他各项资产	7,444,785.59	0.11
8	合计	7,067,040,712.82	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	21,770,965.14	0.31
B	采矿业	50,326,166.00	0.72
C	制造业	4,091,496,469.70	58.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	240,057,886.97	3.46
E	建筑业	287,817,478.72	4.14
F	批发和零售业	426,075,265.39	6.13
G	交通运输、仓储和邮政业	114,228,681.49	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,719,300.88	1.68
J	金融业	4,954,048.00	0.07
K	房地产业	222,242,295.67	3.20
L	租赁和商务服务业	20,883,836.22	0.30

M	科学研究和技术服务业	53,360,100.88	0.77
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	62,686,771.03	0.90
S	综合	-	-
	合计	5,712,619,266.09	82.23

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	000032	深桑达 A	5,773,667	90,588,835.23	1.30
2	002076	雪莱特	11,754,800	83,106,436.00	1.20
3	600461	洪城水业	10,200,003	73,542,021.63	1.06
4	002403	爱仕达	5,300,043	69,854,566.74	1.01
5	002454	松芝股份	5,500,068	69,300,856.80	1.00
6	300138	晨光生物	5,100,073	66,912,957.76	0.96
7	002532	新界泵业	8,200,026	66,830,211.90	0.96
8	300214	日科化学	9,900,074	66,429,496.54	0.96
9	300241	瑞丰光电	5,170,032	66,073,008.96	0.95
10	300067	安诺其	10,500,040	66,045,251.60	0.95
11	000700	模塑科技	8,000,097	64,720,784.73	0.93
12	300298	三诺生物	3,840,044	62,477,515.88	0.90
13	002088	鲁阳节能	5,200,076	62,244,909.72	0.90
14	300092	科新机电	4,890,915	62,114,620.50	0.89
15	002160	常铝股份	8,546,100	60,848,232.00	0.88
16	002438	江苏神通	7,100,066	59,711,555.06	0.86
17	002084	海鸥卫浴	6,700,014	59,563,124.46	0.86
18	002026	山东威达	6,400,057	58,048,516.99	0.84
19	002666	德联集团	9,060,449	57,352,642.17	0.83
20	600203	福日电子	6,800,085	57,052,713.15	0.82
21	300154	瑞凌股份	6,700,075	56,816,636.00	0.82
22	002593	日上集团	10,730,231	56,441,015.06	0.81

23	002536	西泵股份	4,371,778	54,122,611.64	0.78
24	002398	建研集团	4,149,308	53,360,100.88	0.77
25	600101	明星电力	5,414,856	53,336,331.60	0.77
26	300018	中元股份	6,060,153	53,268,744.87	0.77
27	002687	乔治白	6,898,793	53,120,706.10	0.76
28	300305	裕兴股份	5,900,053	52,864,474.88	0.76
29	600117	西宁特钢	10,300,081	51,912,408.24	0.75
30	300254	仟源医药	3,629,304	51,572,409.84	0.74
31	300139	晓程科技	4,875,382	51,142,757.18	0.74
32	000785	武汉中商	4,513,959	50,646,619.98	0.73
33	002546	新联电子	8,400,020	49,980,119.00	0.72
34	002060	粤水电	11,500,000	48,185,000.00	0.69
35	000761	本钢板材	9,088,658	47,533,681.34	0.68
36	002580	圣阳股份	5,831,350	46,592,486.50	0.67
37	002615	哈尔斯	4,100,031	46,330,350.30	0.67
38	300200	高盟新材	3,100,056	45,446,820.96	0.65
39	002693	双成药业	6,800,035	45,356,233.45	0.65
40	601339	百隆东方	7,592,035	45,172,608.25	0.65
41	002520	日发精机	4,700,106	45,027,015.48	0.65
42	600067	冠城大通	6,499,408	44,650,932.96	0.64
43	600405	动力源	5,500,035	44,330,282.10	0.64
44	300030	阳普医疗	3,811,053	44,284,435.86	0.64
45	600792	云煤能源	9,600,069	44,256,318.09	0.64
46	600462	九有股份	5,375,629	43,757,620.06	0.63
47	600846	同济科技	5,300,102	43,301,833.34	0.62
48	002417	三元达	2,793,323	43,296,506.50	0.62
49	300045	华力创通	4,200,026	42,840,265.20	0.62
50	002534	杭锅股份	4,527,934	42,834,255.64	0.62
51	300218	安利股份	3,683,672	42,435,901.44	0.61
52	300165	天瑞仪器	5,173,521	42,422,872.20	0.61
53	300329	海伦钢琴	3,600,044	42,372,517.88	0.61
54	300272	开能环保	4,200,029	42,294,292.03	0.61
55	000757	浩物股份	5,800,082	41,876,592.04	0.60
56	600193	创兴资源	6,000,048	40,620,324.96	0.58
57	600642	申能股份	6,243,200	39,332,160.00	0.57
58	300179	四方达	6,000,035	39,240,228.90	0.56
59	300220	金运激光	2,100,111	39,083,065.71	0.56
60	300141	和顺电气	3,100,194	38,628,417.24	0.56
61	002144	宏达高科	2,248,501	38,224,517.00	0.55

62	002119	康强电子	2,200,043	37,796,738.74	0.54
63	002152	广电运通	4,511,247	37,488,462.57	0.54
64	002661	克明面业	2,300,044	37,329,714.12	0.54
65	002412	汉森制药	2,250,020	35,707,817.40	0.51
66	600738	兰州民百	4,200,039	35,532,329.94	0.51
67	300193	佳士科技	4,270,972	35,491,777.32	0.51
68	300301	长方集团	5,500,079	35,200,505.60	0.51
69	002101	广东鸿图	1,459,965	34,878,563.85	0.50
70	300235	方直科技	2,100,098	34,630,616.02	0.50
71	002613	北玻股份	6,777,846	34,092,565.38	0.49
72	600170	上海建工	8,766,400	33,487,648.00	0.48
73	600269	赣粤高速	6,331,667	32,987,985.07	0.47
74	600823	世茂股份	6,697,740	32,818,926.00	0.47
75	002187	广百股份	2,483,955	30,974,918.85	0.45
76	002111	威海广泰	1,700,086	30,822,559.18	0.44
77	002394	联发股份	2,091,222	30,803,700.06	0.44
78	000886	海南高速	6,100,000	30,256,000.00	0.44
79	300169	天晟新材	3,770,853	29,601,196.05	0.43
80	300019	硅宝科技	2,900,068	29,522,692.24	0.42
81	600585	海螺水泥	1,293,000	29,389,890.00	0.42
82	601678	滨化股份	3,985,000	27,695,750.00	0.40
83	000030	富奥股份	3,082,900	27,561,126.00	0.40
84	600052	浙江广厦	5,449,252	27,518,722.60	0.40
85	300050	世纪鼎利	2,663,832	26,824,788.24	0.39
86	300387	富邦股份	1,300,000	25,740,000.00	0.37
87	600327	大东方	3,117,000	25,528,230.00	0.37
88	300227	光韵达	1,115,581	24,196,951.89	0.35
89	002607	亚夏汽车	4,895,926	22,374,381.82	0.32
90	002381	双箭股份	2,400,032	20,976,279.68	0.30
91	600028	中国石化	3,407,600	20,207,068.00	0.29
92	002533	金杯电工	2,657,471	20,090,480.76	0.29
93	601390	中国中铁	2,244,300	19,458,081.00	0.28
94	600894	广日股份	1,534,315	18,166,289.60	0.26
95	601636	旗滨集团	3,917,230	17,666,707.30	0.25
96	600684	珠江实业	2,000,011	17,600,096.80	0.25
97	600757	长江传媒	2,355,800	17,597,826.00	0.25
98	000883	湖北能源	3,434,000	17,238,680.00	0.25
99	002430	杭氧股份	1,955,257	17,186,709.03	0.25
100	600035	楚天高速	3,102,060	17,092,350.60	0.25

101	600875	东方电气	1,774,400	16,998,752.00	0.24
102	002100	天康生物	2,081,327	16,713,055.81	0.24
103	600284	浦东建设	1,554,400	16,663,168.00	0.24
104	601107	四川成渝	3,517,100	16,600,712.00	0.24
105	600510	黑牡丹	2,165,900	16,590,794.00	0.24
106	600308	华泰股份	2,862,500	16,259,000.00	0.23
107	000531	穗恒运 A	1,699,781	16,181,915.12	0.23
108	002416	爱施德	1,482,300	15,994,017.00	0.23
109	002380	科远股份	861,391	15,892,663.95	0.23
110	000936	华西股份	2,243,000	15,745,860.00	0.23
111	000900	现代投资	1,709,800	15,730,160.00	0.23
112	000876	新希望	1,901,900	15,633,618.00	0.23
113	002463	沪电股份	3,424,861	15,583,117.55	0.22
114	600180	瑞茂通	1,107,337	15,547,011.48	0.22
115	000948	南天信息	1,272,389	15,472,250.24	0.22
116	300158	振东制药	953,045	15,458,389.90	0.22
117	600020	中原高速	3,056,900	15,406,776.00	0.22
118	000733	振华科技	958,641	15,242,391.90	0.22
119	601567	三星医疗	1,462,077	15,234,842.34	0.22
120	600499	科达洁能	1,874,800	14,885,912.00	0.21
121	002595	豪迈科技	666,585	14,818,184.55	0.21
122	002225	濮耐股份	2,709,574	14,767,178.30	0.21
123	000417	合肥百货	1,787,470	14,746,627.50	0.21
124	002479	富春环保	1,236,440	14,713,636.00	0.21
125	000719	大地传媒	1,409,357	14,699,593.51	0.21
126	002527	新时达	1,382,076	14,691,467.88	0.21
127	002081	金螳螂	1,337,882	14,689,944.36	0.21
128	002293	罗莱生活	1,281,531	14,686,345.26	0.21
129	600261	阳光照明	2,235,200	14,685,264.00	0.21
130	002002	鸿达兴业	1,871,000	14,649,930.00	0.21
131	002440	闰土股份	957,103	14,605,391.78	0.21
132	600565	迪马股份	2,646,800	14,583,868.00	0.21
133	002133	广宇集团	2,623,401	14,533,641.54	0.21
134	002775	文科园林	714,446	14,474,675.96	0.21
135	000419	通程控股	1,887,920	13,366,473.60	0.19
136	601899	紫金矿业	3,879,000	13,304,970.00	0.19
137	600323	瀚蓝环境	904,200	13,119,942.00	0.19
138	002713	东易日盛	642,780	13,093,428.60	0.19
139	002376	新北洋	919,683	12,618,050.76	0.18

140	600081	东风科技	1,010,200	12,576,990.00	0.18
141	601965	中国汽研	1,321,331	12,407,298.09	0.18
142	300498	温氏股份	517,724	12,135,450.56	0.17
143	600335	国机汽车	921,997	11,027,084.12	0.16
144	002712	思美传媒	493,100	10,641,098.00	0.15
145	600723	首商股份	1,167,904	10,417,703.68	0.15
146	002354	天神娱乐	484,100	10,408,150.00	0.15
147	600761	安徽合力	793,401	10,393,553.10	0.15
148	600051	宁波联合	1,083,532	10,358,565.92	0.15
149	300360	炬华科技	682,150	10,266,357.50	0.15
150	600587	新华医疗	571,900	10,168,382.00	0.15
151	601117	中国化学	1,447,300	10,116,627.00	0.15
152	601515	东风股份	878,715	9,929,479.50	0.14
153	300258	精锻科技	596,257	9,844,203.07	0.14
154	601179	中国西电	1,755,700	9,761,692.00	0.14
155	601137	博威合金	856,966	9,735,133.76	0.14
156	601877	正泰电器	484,300	9,729,587.00	0.14
157	300349	金卡智能	346,400	9,671,488.00	0.14
158	601928	凤凰传媒	987,700	9,639,952.00	0.14
159	002706	良信电器	807,602	9,594,311.76	0.14
160	300182	捷成股份	975,873	9,329,345.88	0.13
161	002367	康力电梯	798,200	9,322,976.00	0.13
162	000739	普洛药业	1,265,600	9,289,504.00	0.13
163	300233	金城医药	440,568	9,247,522.32	0.13
164	600183	生益科技	740,500	9,137,770.00	0.13
165	600742	一汽富维	471,141	9,003,504.51	0.13
166	000960	锡业股份	655,000	8,914,550.00	0.13
167	002554	惠博普	1,488,600	8,782,740.00	0.13
168	002363	隆基机械	916,653	8,662,370.85	0.12
169	600105	永鼎股份	1,059,442	8,549,696.94	0.12
170	600271	航天信息	413,000	8,524,320.00	0.12
171	601238	广汽集团	324,400	8,453,864.00	0.12
172	000919	金陵药业	765,563	8,283,391.66	0.12
173	600960	渤海活塞	1,083,700	8,268,631.00	0.12
174	300306	远方光电	476,672	8,260,725.76	0.12
175	300286	安科瑞	398,983	8,231,019.29	0.12
176	002275	桂林三金	463,312	8,205,255.52	0.12
177	000541	佛山照明	890,300	8,110,633.00	0.12
178	002051	中工国际	387,720	8,037,435.60	0.12

179	000718	苏宁环球	1,371,300	8,035,818.00	0.12
180	002382	蓝帆医疗	638,694	7,811,227.62	0.11
181	002315	焦点科技	311,657	7,772,725.58	0.11
182	300204	舒泰神	477,469	7,443,741.71	0.11
183	002662	京威股份	988,200	7,115,040.00	0.10
184	601058	赛轮金宇	2,053,700	7,023,654.00	0.10
185	000065	北方国际	291,000	6,919,980.00	0.10
186	002090	金智科技	283,800	6,740,250.00	0.10
187	600978	宜华生活	628,417	6,315,590.85	0.09
188	002115	三维通信	600,095	6,192,980.40	0.09
189	601800	中国交建	386,900	6,147,841.00	0.09
190	600745	中茵股份	310,899	5,816,920.29	0.08
191	600229	城市传媒	588,800	5,517,056.00	0.08
192	002559	亚威股份	506,753	5,513,472.64	0.08
193	000665	湖北广电	453,472	5,509,684.80	0.08
194	600580	卧龙电气	801,400	5,465,548.00	0.08
195	600168	武汉控股	594,800	5,359,148.00	0.08
196	002714	牧原股份	186,100	5,065,642.00	0.07
197	603128	华贸物流	588,200	5,034,992.00	0.07
198	002006	精功科技	634,118	5,015,873.38	0.07
199	600114	东睦股份	286,480	5,013,400.00	0.07
200	600597	光明乳业	391,700	4,994,175.00	0.07
201	002048	宁波华翔	239,100	4,987,626.00	0.07
202	000415	渤海金控	740,100	4,980,873.00	0.07
203	000955	欣龙控股	856,596	4,968,256.80	0.07
204	600438	通威股份	889,800	4,965,084.00	0.07
205	601288	农业银行	1,407,400	4,954,048.00	0.07
206	600690	青岛海尔	329,100	4,952,955.00	0.07
207	000418	小天鹅 A	105,700	4,945,703.00	0.07
208	600886	国投电力	625,600	4,942,240.00	0.07
209	600073	上海梅林	517,300	4,940,215.00	0.07
210	300184	力源信息	396,586	4,933,529.84	0.07
211	600348	阳泉煤业	726,800	4,927,704.00	0.07
212	601668	中国建筑	508,800	4,925,184.00	0.07
213	002496	辉丰股份	991,300	4,916,848.00	0.07
214	601677	明泰铝业	359,900	4,909,036.00	0.07
215	600983	惠而浦	453,500	4,906,870.00	0.07
216	600122	宏图高科	441,800	4,903,980.00	0.07
217	000550	江铃汽车	236,700	4,899,690.00	0.07

218	600897	厦门空港	193,000	4,898,340.00	0.07
219	601098	中南传媒	262,298	4,889,234.72	0.07
220	000902	新 洋 丰	542,560	4,883,040.00	0.07
221	601186	中国铁建	404,800	4,869,744.00	0.07
222	601600	中国铝业	1,076,100	4,863,972.00	0.07
223	000590	启迪古汉	285,675	4,636,505.25	0.07
224	000713	丰乐种业	557,982	4,569,872.58	0.07
225	300049	福瑞股份	270,886	4,569,846.82	0.07
226	300150	世纪瑞尔	589,608	4,469,228.64	0.06
227	603118	共进股份	322,623	4,397,351.49	0.06
228	002483	润邦股份	664,492	4,379,002.28	0.06
229	601006	大秦铁路	520,500	4,366,995.00	0.06
230	002003	伟星股份	417,437	4,362,216.65	0.06
231	002550	千红制药	734,200	4,361,148.00	0.06
232	300195	长荣股份	305,100	4,356,828.00	0.06
233	000926	福星股份	355,500	4,337,100.00	0.06
234	600415	小商品城	592,000	4,286,080.00	0.06
235	300290	荣科科技	401,290	4,245,648.20	0.06
236	601900	南方传媒	339,200	4,219,648.00	0.06
237	002337	赛象科技	721,908	4,215,942.72	0.06
238	002718	友邦吊顶	71,631	4,172,505.75	0.06
239	600736	苏州高新	576,419	4,075,282.33	0.06
240	000521	美菱电器	624,100	3,994,240.00	0.06
241	300112	万讯自控	337,263	3,922,368.69	0.06
242	603188	亚邦股份	224,800	3,920,512.00	0.06
243	002240	威华股份	327,126	3,843,730.50	0.06
244	300464	星徽精密	292,089	3,642,349.83	0.05
245	000425	徐工机械	963,300	3,612,375.00	0.05
246	600235	民丰特纸	465,417	3,583,710.90	0.05
247	600312	平高电气	255,000	3,503,700.00	0.05
248	300040	九洲电气	341,900	3,466,866.00	0.05
249	600128	弘业股份	309,744	3,373,112.16	0.05
250	603399	新华龙	257,540	3,268,182.60	0.05
251	000835	长城动漫	327,037	3,208,232.97	0.05
252	002243	通产丽星	329,121	3,182,600.07	0.05
253	300245	天玑科技	208,959	2,914,978.05	0.04
254	603002	宏昌电子	543,228	2,879,108.40	0.04
255	600573	惠泉啤酒	283,566	2,875,359.24	0.04
256	600560	金白天正	220,240	2,792,643.20	0.04

257	600297	广汇汽车	347,800	2,618,934.00	0.04
258	000930	中粮生化	241,400	2,602,292.00	0.04
259	002191	劲嘉股份	274,800	2,572,128.00	0.04
260	000036	华联控股	281,100	2,558,010.00	0.04
261	600778	友好集团	330,251	2,552,840.23	0.04
262	600188	兖州煤业	206,600	2,528,784.00	0.04
263	300328	宜安科技	224,953	2,496,978.30	0.04
264	002578	闽发铝业	546,928	2,373,667.52	0.03
265	600272	开开实业	169,065	2,309,427.90	0.03
266	300358	楚天科技	157,564	2,248,438.28	0.03
267	300243	瑞丰高材	200,085	2,206,937.55	0.03
268	002521	齐峰新材	219,800	2,171,624.00	0.03
269	300303	聚飞光电	499,400	2,162,402.00	0.03
270	000628	高新发展	219,240	2,102,511.60	0.03
271	600475	华光股份	105,400	2,100,622.00	0.03
272	600980	北矿科技	118,498	2,053,570.34	0.03
273	000014	沙河股份	118,416	1,994,125.44	0.03
274	600615	丰华股份	121,015	1,915,667.45	0.03
275	600352	浙江龙盛	198,300	1,889,799.00	0.03
276	002139	拓邦股份	156,691	1,687,562.07	0.02
277	000157	中联重科	342,000	1,535,580.00	0.02
278	000631	顺发恒业	339,700	1,498,077.00	0.02
279	002641	永高股份	283,500	1,482,705.00	0.02
280	000752	西藏发展	118,557	1,479,591.36	0.02
281	002660	茂硕电源	147,376	1,405,967.04	0.02
282	000929	兰州黄河	97,386	1,354,639.26	0.02
283	300162	雷曼股份	120,570	1,269,602.10	0.02
284	000593	大通燃气	139,379	1,227,928.99	0.02
285	002209	达意隆	73,908	988,889.04	0.01
286	300071	华谊嘉信	115,301	933,938.10	0.01
287	300041	回天新材	64,327	818,239.44	0.01
288	000951	中国重汽	49,200	752,268.00	0.01
289	002062	宏润建设	108,400	646,064.00	0.01
290	600350	山东高速	103,100	639,220.00	0.01
291	002557	洽洽食品	43,900	635,233.00	0.01
292	002039	黔源电力	43,205	628,200.70	0.01
293	000667	美好置业	187,500	620,625.00	0.01
294	002548	金新农	51,300	619,704.00	0.01
295	601999	出版传媒	67,300	613,776.00	0.01

296	600023	浙能电力	112,200	612,612.00	0.01
297	600969	郴电国际	42,600	604,920.00	0.01
298	002150	通润装备	51,300	602,775.00	0.01
299	600676	交运股份	80,200	597,490.00	0.01
300	600850	华东电脑	27,806	594,214.22	0.01
301	601188	龙江交通	122,400	589,968.00	0.01
302	603100	川仪股份	50,700	588,627.00	0.01
303	600766	园城黄金	45,992	574,900.00	0.01
304	000530	大冷股份	79,660	573,552.00	0.01
305	600641	万业企业	51,100	570,276.00	0.01
306	601313	江南嘉捷	62,700	551,133.00	0.01
307	600979	广安爱众	77,986	446,079.92	0.01
308	601228	广州港	32,911	283,692.82	0.00
309	000708	大冶特钢	19,200	222,720.00	0.00
310	600302	标准股份	26,700	221,610.00	0.00
311	300046	台基股份	11,700	218,790.00	0.00
312	002014	永新股份	16,700	210,587.00	0.00
313	002540	亚太科技	29,800	210,388.00	0.00
314	000570	苏常柴 A	29,600	207,200.00	0.00
315	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
316	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.00
317	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
318	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
319	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
320	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
321	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
322	002856	美芝股份	1,230	39,187.80	0.00
323	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.00
324	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
325	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
326	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
327	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
328	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
329	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
330	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
331	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
332	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
333	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
334	603138	海量数据	425	18,904.00	0.00

335	002882	金 龙 羽	2,966	18,389.20	0.00
336	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
337	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
338	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
339	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
340	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
341	300672	国 科 微	1,257	10,659.36	0.00
342	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
343	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
344	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
345	603626	科森科技	96	6,257.28	0.00
346	300610	晨化股份	144	3,379.68	0.00
347	603238	诺邦股份	50	1,469.00	0.00
348	002361	神剑股份	44	332.64	0.00
349	300345	红宇新材	30	266.40	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	002687	乔 治 白	83,928,350.00	0.77
2	300254	仟源医药	81,998,416.89	0.75
3	000593	大通燃气	80,862,367.62	0.74
4	002084	海鸥卫浴	79,338,655.93	0.72
5	600101	明星电力	78,578,567.95	0.72
6	002693	双成药业	78,206,329.10	0.71
7	002607	亚夏汽车	78,160,303.57	0.71
8	000757	浩物股份	77,660,807.34	0.71
9	002026	山东威达	77,184,039.82	0.71
10	000835	长城动漫	76,977,775.08	0.70
11	300241	瑞丰光电	75,988,796.67	0.69
12	000785	武汉中商	70,281,938.35	0.64
13	000632	三木集团	70,208,749.87	0.64
14	002111	威海广泰	70,182,741.70	0.64
15	002240	威华股份	70,117,045.40	0.64
16	002337	赛象科技	69,872,820.78	0.64

17	600272	开开实业	69,710,196.01	0.64
18	300018	中元股份	69,405,839.25	0.63
19	300092	科新机电	69,160,485.44	0.63
20	300165	天瑞仪器	68,991,693.29	0.63

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	002457	青龙管业	136,734,343.97	1.25
2	002361	神剑股份	106,043,555.71	0.97
3	600984	建设机械	104,062,834.81	0.95
4	000666	经纬纺机	97,385,201.35	0.89
5	000619	海螺型材	97,098,285.84	0.89
6	600326	西藏天路	96,840,168.89	0.88
7	002169	智光电气	96,491,608.92	0.88
8	600727	鲁北化工	94,750,348.98	0.87
9	300041	回天新材	94,291,336.98	0.86
10	601137	博威合金	94,221,048.86	0.86
11	002066	瑞泰科技	94,058,758.21	0.86
12	300289	利德曼	92,544,279.26	0.85
13	002054	德美化工	92,319,973.27	0.84
14	600279	重庆港九	92,009,078.61	0.84
15	002487	大金重工	91,092,921.42	0.83
16	600889	南京化纤	91,055,598.88	0.83
17	002107	沃华医药	90,846,730.74	0.83
18	300313	天山生物	90,655,567.56	0.83
19	002136	安纳达	90,278,339.70	0.82
20	002591	恒大高新	89,937,536.68	0.82

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,850,290,264.15
卖出股票收入（成交）总额	8,405,445,526.44

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	1,627,643.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	650,166.66
5	应收申购款	5,166,975.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,444,785.59

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	000032	深桑达 A	90,588,835.23	1.30	拟筹划重大资产重组
2	002076	雪莱特	83,106,436.00	1.20	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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信量化先锋混合 A	606,754	7,378.88	1,310,730,263.77	29.28%	3,166,434,454.14	70.72%
长信量化先锋混合 C	89	11,977.04	0.00	0.00%	1,065,956.61	100.00%
合计	606,843	7,379.55	1,310,730,263.77	29.27%	3,167,500,410.75	70.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信量化先锋混合 A	445,967.37	0.01%
	长信量化先锋混合 C	0.00	0.00%
	合计	445,967.37	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信量化先锋混合 A	0
	长信量化先锋混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信量化先锋混合 A	0
	长信量化先锋混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
基金合同生效日（2010 年 11 月 18 日）基金份额总额	324,671,697.42	-
本报告期期初基金份额总额	5,557,393,335.62	-
本报告期基金总申购份额	2,555,680,278.24	1,455,026.05
减：本报告期基金总赎回份额	3,635,908,895.95	389,069.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	4,477,164,717.91	1,065,956.61

§ 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

本报告期基金管理人、托管人专门的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	2,465,226,072.90	17.31%	2,101,783.59	21.67%	-
中泰证券	1	1,849,628,182.46	12.99%	1,537,596.97	15.86%	-
爱建证券	1	1,573,031,780.29	11.04%	835,748.16	8.62%	-
东方证券	1	1,227,628,223.45	8.62%	652,240.08	6.73%	-

兴业证券	2	1,148,612,311.68	8.06%	954,843.75	9.85%	-
国泰君安	1	1,124,253,555.75	7.89%	597,318.78	6.16%	-
海通证券	1	991,892,545.55	6.96%	526,993.90	5.43%	-
天风证券	1	906,840,548.05	6.37%	481,805.01	4.97%	-
东北证券	1	803,809,502.71	5.64%	427,064.67	4.40%	-
国金证券	1	783,478,929.77	5.50%	651,305.67	6.72%	-
光大证券	1	676,574,527.00	4.75%	562,436.07	5.80%	-
平安证券	1	535,571,905.39	3.76%	284,545.83	2.93%	-
方正证券	1	157,145,701.52	1.10%	83,490.96	0.86%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广发证券退租	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	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长信量化先锋混合型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 1 月 4 日
2	长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同（增加 C 份额后更新的合同）	公司网站	2017 年 1 月 4 日
3	长信量化先锋混合型证券投资基金托管协议（增加 C 份额后更新的托管协议）	公司网站	2017 年 1 月 4 日
4	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 1 月 5 日
5	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金 C 类基金份额净值及累计份额净值计算与披露方法的说明	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 1 月 7 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 1 月 11 日
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	长信量化先锋混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
13	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
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交通银行股份有限公司手机银	上证报、中证报、证券时报、公司网	2017 年 2 月 23 日

	行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	站	
15	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年3月9日
16	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
17	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金的分红预告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年3月21日
18	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
19	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
20	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金 2017 年第一次分红公告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年3月24日
21	长信量化先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年3月27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
23	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
24	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
25	长信量化先锋混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年4月22日
26	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
27	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

28	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
29	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
30	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
31	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
32	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金恢复大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	中证报、证券时报、 证券日报、公司网站	2017年6月14日
33	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先锋混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化先锋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