

长信银利精选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：中国农业银行股份有限公司

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责任。本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信银利精选混合型证券投资基金
基金简称	长信银利精选混合
场内简称	长信银利
基金主代码	519996
前端交易代码	519997
后端交易代码	519996
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 1 月 17 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	786,934,651.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于大盘、价值型股票，并在保持基金财产安全性和流动性的前提下，谋求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、复合型投资策略</p> <p>“由上至下”的资产配置流程与“由下至上”的选股流程相结合的投资策略。其中，“由上至下”的资产配置流程表现为：从宏观层面出发，在控制风险前提下优化资产的配置比例；“由下至上”的选股流程表现为：从微观层面出发，通过对投资对象深入系统的分析来挖掘上市公司的内在价值，积极寻求价值被低估的证券进行投资。</p> <p>2、适度分散投资策略</p> <p>在确保基金财产的安全性和流动性的前提下，在对宏观经济、行业、公司和证券市场等因素深入分析的基础上，适度分散投资于个股，谋求基金财产的长期稳定增值。</p> <p>3、动态调整策略</p> <p>体现为投资组合中个股的动态调整策略和股票仓位的动态调整策略两方面。投资组合中个股的动态调整策略是指：基于对各种影响因素变化的深入分析，定期或临时调整投资组合中的个股投资比例。股票仓位的动态调整策略是指：基于对股票市场趋势的研判，动态调整股票仓位。</p>
业绩比较基准	标普中国 A 股 100 指数×80%+中证综合债指数×20%

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		成善栋	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报和证券时报
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、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

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	-9,372,032.43
本期利润	83,396,422.12
加权平均基金份额本期利润	0.1147
本期加权平均净值利润率	11.81%
本期基金份额净值增长率	11.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	23,332,125.15
期末可供分配基金份额利润	0.0296
期末基金资产净值	810,266,776.95
期末基金份额净值	1.0296
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	347.56%

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、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、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。

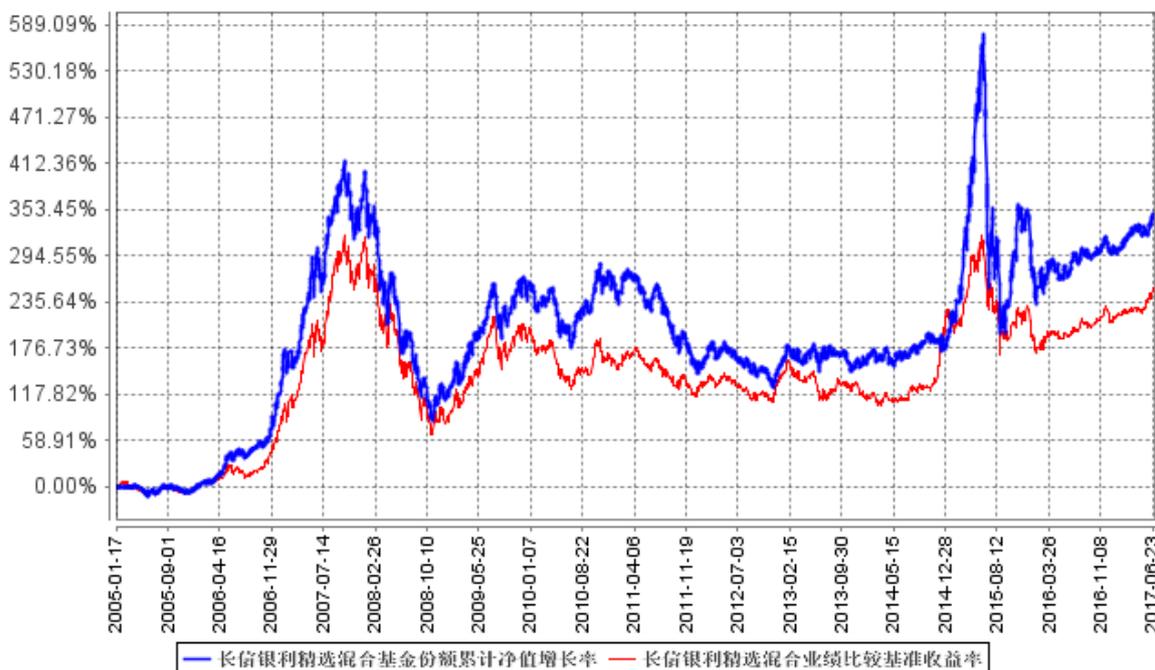
3.2 基金净值表现

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	5.67%	0.67%	4.66%	0.66%	1.01%	0.01%
过去三个月	4.91%	0.70%	8.35%	0.56%	-3.44%	0.14%
过去六个月	11.93%	0.61%	13.24%	0.48%	-1.31%	0.13%
过去一年	17.66%	0.62%	19.92%	0.53%	-2.26%	0.09%
过去三年	65.74%	2.03%	66.83%	1.36%	-1.09%	0.67%
自基金合同	347.56%	1.63%	253.85%	1.43%	93.71%	0.20%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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 2005 年 1 月 17 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高远	长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理、研究发展部总监	2017年1月5日	-	7年	复旦大学经济学博士，具有基金从业资格。2014年加入长信基金管理有限责任公司，曾任研究发展部副总监，现任研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理。
毛楠	曾任本基金的基金经理	2015年5月16日	2017年2月21日	10年	曾任本基金的基金经理

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

整体看，市场在 2017 年上半年 A 股市场呈现上涨走势。期间上证指数上涨 2.86%，沪深 300 指数上涨 10.78%，中小板指数上涨 7.33%，创业板指数下跌 7.34%。从行业结构看，家电、食品饮料及保险等板块表现较好，而 TMT 行业除了电子板块之外整体表现较弱。风格差异较为明显，沪深 300 和创业板的业绩表现差距超过 10%。

2017 年上半年本基金股票持仓比例相对中性，并对沪深 300 指数中的成分股维持了较高的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0296 元，报告期基金份额净值增长率为 11.93%，成立以来的累计净值为 2.9496 元，本期业绩比较基准增长率为 13.24%，基金波动率为 0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年三季度我们对市场保持相对中性偏乐观的态度，缘于：

- 1、经济的韧性有可能超预期，企业盈利的下行趋势会比之前预测的缓慢；
- 2、货币政策在 2017 年半年末偏宽松，三季度进一步宽松的概率偏小，更可能是不松不紧的态度；
- 3、“稳定宏观政策、稳定市场预期、稳定金融运行”表明了“稳”是政策的主基调。

我们认为宏观经济在三季度将较有韧性，经济超预期概率偏大。另一方面，各项经济政策更强调“稳”的主基调。因此，我们判断，市场在三季度将在窄幅区间内运行。然而，四季度我们觉得要警惕市场回调的风险，缘于经济下行压力届时大概率会加大，美联储缩表和加息将会带来较大的不确定性等。

本基金未来的投资思路将在中性偏高仓位下重点配置景气向上且估值合理的行业，适当增持

受供给侧改革利好而需求增速尚可的周期品以及估值偏低的金融股等，并重点关注新能源汽车和 PPP 板块。对 2017 年业绩增速预期在 30%以上，2017 年市盈率预期在 30 倍以内的个股，我们将重点考虑配置。

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、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金红利方式；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

5、如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、基金收益分配比例不低于基金会计年度净收益的 90%；

7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，每年至多分配 4 次。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

8、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：长信银利精选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	51,096,941.96	53,252,104.90
结算备付金		2,144,198.29	1,013,168.56
存出保证金		633,447.28	503,667.38
交易性金融资产	6.4.6.2	757,081,160.59	621,480,058.90
其中：股票投资		631,933,211.29	501,473,440.78
基金投资		-	-
债券投资		125,147,949.30	120,006,618.12
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	-	10,000,000.00
应收证券清算款		4,967,137.34	3,975,311.28
应收利息	6.4.6.5	1,297,106.03	596,047.48
应收股利		-	-
应收申购款		63,306.05	13,111.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		817,283,297.54	690,833,470.46
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		3,195,283.39	19,073,683.33
应付赎回款		987,616.43	190,825.03
应付管理人报酬		974,363.26	866,257.02
应付托管费		162,393.86	144,376.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	892,014.14	1,555,360.54

应交税费		1,886.40	1,886.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	802,963.11	869,127.94
负债合计		7,016,520.59	22,701,516.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	786,934,651.80	726,326,444.24
未分配利润	6.4.6.10	23,332,125.15	-58,194,490.20
所有者权益合计		810,266,776.95	668,131,954.04
负债和所有者权益总计		817,283,297.54	690,833,470.46

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0296 元，基金份额总额 786,934,651.80 份。

6.2 利润表

会计主体：长信银利精选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		92,622,452.83	-101,614,811.45
1.利息收入		1,437,703.69	822,890.21
其中：存款利息收入	6.4.6.11	280,015.56	176,490.43
债券利息收入		1,157,285.35	646,399.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		402.78	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,603,659.92	-37,038,044.36
其中：股票投资收益	6.4.6.12	21,814,988.63	-40,851,869.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-27,136,381.78	22,185.00
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	3,717,733.23	3,791,639.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	92,768,454.55	-65,427,195.16
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	19,954.51	27,537.86
减：二、费用		9,226,030.71	7,197,857.44

1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	5,236,807.04	5,048,454.09
2. 托管费	6.4.9.2.2	872,801.11	841,409.02
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.6.19	2,955,754.15	1,157,527.45
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	160,668.41	150,466.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		83,396,422.12	-108,812,668.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		83,396,422.12	-108,812,668.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信银利精选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）	726,326,444.24	-58,194,490.20	668,131,954.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83,396,422.12	83,396,422.12
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）	60,608,207.56	-1,869,806.77	58,738,400.79
其中：1.基金申购款	113,733,877.27	-3,139,767.83	110,594,109.44
2.基金赎回款	-53,125,669.71	1,269,961.06	-51,855,708.65
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）	786,934,651.80	23,332,125.15	810,266,776.95
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

及其配套规则、《长信银利精选开放式证券投资基金基金合同》和《长信银利精选开放式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国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产 60%-80%;债券资产 15%-35%;现金类资产 5%-15%。其中,投资于股票、债券的比重不低于本基金资产总值的 80%,投资于大盘价值股的比例不低于本基金股票资产的 80%。如果法律法规有最新规定的,本基金从其规定。

2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信银利精选混合型证券投资基金,本基金业绩比较基准变更为:中信标普 100 指数 \times 80%+中证综合债指数 \times 20%,关于基金更名及变更业绩比较基准的事宜,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》。

根据标普道琼斯指数公司变更旗下部分指数名称的通知,本基金业绩比较基准所涉及的“中信标普 100 指数”更名为“标普中国 A 股 100 指数”,故本基金的业绩比较基准相应的进行调整。

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

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

6.4.5 税项

6.4.5.1 主要税项说明

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。

6.4.5.2 应交税费

单位：人民币元

应交债券利息收入所得税	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
		1,886.40

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的税费部分。

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	51,096,941.96
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	51,096,941.96

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	563,118,887.93	631,933,211.29	68,814,323.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	136,301,749.39	125,147,949.30
	银行间市场	-	-
	合计	136,301,749.39	125,147,949.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	699,420,637.32	757,081,160.59	57,660,523.27

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	12,850.99
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	964.90
应收债券利息	1,283,005.03
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	285.10
合计	1,297,106.03

注：其他为保证金利息。

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	892,014.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	892,014.14

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	250,000.00
应付赎回费	73.79
预提信息披露费	439,177.14
审计费用	104,712.18
预提账户维护费	9,000.00
合计	802,963.11

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	726,326,444.24	726,326,444.24
本期申购	113,733,877.27	113,733,877.27
本期赎回(以“-”号填列)	-53,125,669.71	-53,125,669.71
- 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	786,934,651.80	786,934,651.80

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	270,128,597.11	-328,323,087.31	-58,194,490.20
本期利润	-9,372,032.43	92,768,454.55	83,396,422.12
本期基金份额交易产生的变动数	21,064,585.29	-22,934,392.06	-1,869,806.77
其中：基金申购款	40,667,124.79	-43,806,892.62	-3,139,767.83
基金赎回款	-19,602,539.50	20,872,500.56	1,269,961.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	281,821,149.97	-258,489,024.82	23,332,125.15

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	251,149.97
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	19,593.39
其他	9,272.20
合计	280,015.56

注：此处其他为存出保证金和其他存款利息收入为基金申购款的利息收入。

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	980,103,673.31
减：卖出股票成本总额	958,288,684.68
买卖股票差价收入	21,814,988.63

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**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,136,381.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-27,136,381.78

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	69,897,110.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	96,885,267.60
减：应收利息总额	148,224.58
买卖债券差价收入	-27,136,381.78

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	3,717,733.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,717,733.23

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	92,768,454.55
——股票投资	70,058,517.61
——债券投资	22,709,936.94
——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	92,768,454.55

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	17,992.97
转换费收入	1,961.54
合计	19,954.51

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	2,955,754.15

银行间市场交易费用	-
合计	2,955,754.15

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	99,177.14
账户维护费	18,120.00
其他费用	8,659.09
合计	160,668.41

注：其他费用为银行划汇费。

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	435,814,124.36	21.85%	188,918,672.45	25.25%

6.4.9.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长江证券	11,747,585.30	7.87%	-	-

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	362,293.06	20.15%	362,293.06	40.62%
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	161,220.99	23.64%	-	-

注：股票交易佣金计提标准如下：

$$\text{深圳证券交易所交易佣金} = \text{买(卖)成交金额} \times 1\% - \text{清算库中买(卖)经手费} - \text{证券结算风险基金}$$

(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述佣金比率均在合理商业条款范围内收取,并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》,本基金的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和债券交易的同时,还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	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	5,236,807.04	5,048,454.09
其中:支付销售机构的客户维护费	-	1,175,521.14

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%的年费率计提,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 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托管费	872,801.11	841,409.02

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
基金合同生效日（2005 年 1 月 17 日）持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	4,909,546.32	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	4,909,546.32	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.63%

注：基金管理人运用固有资金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。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
中国农业银行	51,096,941.96	251,149.97	48,815,128.21	160,693.39

注：本基金通过“中国农业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 2,144,198.29 元。（2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,013,168.56 元）

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 利润分配情况

注：本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.11 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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20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20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
601919	中远海控	2017年5月17日	临时停牌	5.35	2017年7月26日	5.89	1,000,000	5,595,459.20	5,350,000.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	临时停牌	7.79	-	-	670,000	4,598,300.00	5,219,300.00	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	临时停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

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中国农业银行，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	41,129,006.1	50,578,060.00
AAA 以下	2,562,516.00	45,221,058.12
未评级	81,456,427.20	24,207,500.00
合计	125,147,949.30	120,006,618.12

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单及超短期融资券等无信用评级债券。根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置含义

AAA 偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。

AA 偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。

A 偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。

BBB 偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。

BB 偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。

B 偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。

CCC 偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。

CC 在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。

C 不能偿还债务。

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、结算备付金及存出保证金等。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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.12.4.1.1 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	51,096,941.96	-	-	-	-	51,096,941.96
结算备付金	2,144,198.29	-	-	-	-	2,144,198.29
存出保证金	633,447.28	-	-	-	-	633,447.28
交易性金融资产	-	30,083,906.40	61,522,667.20	33,541,375.70	631,933,211.29	757,081,160.59
应收证券清算款	-	-	-	-	4,967,137.34	4,967,137.34
应收利息	-	-	-	-	1,297,106.03	1,297,106.03
应收申购款	-	-	-	-	63,306.05	63,306.05
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	53,874,587.53	30,083,906.40	61,522,667.20	33,541,375.70	638,260,760.71	817,283,297.54
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	3,195,283.39	3,195,283.39
应付赎回款	-	-	-	-	987,616.43	987,616.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	974,363.26	974,363.26
应付托管费	-	-	-	-	162,393.86	162,393.86
应付交易费用	-	-	-	-	892,014.14	892,014.14
应交税费	-	-	-	-	1,886.40	1,886.40
其他负债	-	-	-	-	802,963.11	802,963.11
负债总计	-	-	-	-	7,016,520.59	7,016,520.59
利率敏感度缺口	53,874,587.53	30,083,906.40	61,522,667.20	33,541,375.70	631,244,240.12	810,266,776.95
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	53,252,104.90	-	-	-	-	53,252,104.90
结算备付金	1,013,168.56	-	-	-	-	1,013,168.56
存出保证金	503,667.38	-	-	-	-	503,667.38
交易性金融资产	50,578,060.00	45,221,058.12	24,207,500.00	-	501,473,440.78	621,480,058.90
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	-	10,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	3,975,311.28	3,975,311.28
应收利息	-	-	-	-	596,047.48	596,047.48
应收申购款	-	-	-	-	13,111.96	13,111.96
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	115,347,000.84	45,221,058.12	24,207,500.00	-	506,057,911.50	690,833,470.46
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	19,073,683.33	19,073,683.33
应付赎回款	-	-	-	-	190,825.03	190,825.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	866,257.02	866,257.02

应付托管费	-	-	-	-	144,376.16	144,376.16
应付交易费用	-	-	-	-	1,555,360.54	1,555,360.54
应交税费	-	-	-	-	1,886.40	1,886.40
其他负债	-	-	-	-	869,127.94	869,127.94
负债总计	-	-	-	-	22,701,516.42	22,701,516.42
利率敏感度缺口	115,347,000.84	45,221,058.12	24,207,500.00	-	483,356,395.08	668,131,954.04

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率下降27个基点	1,385,052.92	1,207,983.01
	市场利率上升27个基点	-1,385,052.92	-1,207,983.01

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，所面临的重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	631,933,211.29	77.99	501,473,440.78	75.06
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	125,147,949.30	15.45	120,006,618.12	17.96
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	757,081,160.59	93.44	621,480,058.90	93.02

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 0.86%（2016年12月31日 VaR 值为 2.48%）	-6,977,964.85	-16,569,672.46

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

	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	621,206,839.64	10,726,371.65	-	631,933,211.29
债券投资	-	125,147,949.30	-	125,147,949.30
合计	621,159,316.84	135,921,843.75	-	757,081,160.59

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

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	631,933,211.29	77.32
	其中：股票	631,933,211.29	77.32
2	固定收益投资	125,147,949.30	15.31
	其中：债券	125,147,949.30	15.31
	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	53,241,140.25	6.51
7	其他各项资产	6,960,996.70	0.85
8	合计	817,283,297.54	100.00

注：本基金本报告期内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	14,539,013.28	1.79
B	采矿业	13,100,000.00	1.62
C	制造业	383,638,128.32	47.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,911,672.40	3.94
E	建筑业	68,621,718.17	8.47
F	批发和零售业	55,188,074.00	6.81
G	交通运输、仓储和邮政业	5,350,000.00	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,613,197.41	1.56
J	金融业	38,909,560.59	4.80
K	房地产业	8,020,000.00	0.99
L	租赁和商务服务业	41,847.12	0.01

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	631,933,211.29	77.99

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：本基金本报告期内未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	002241	歌尔股份	2,180,038	42,031,132.64	5.19
2	600491	龙元建设	2,972,779	31,897,918.67	3.94
3	601933	永辉超市	4,382,300	31,026,684.00	3.83
4	600519	贵州茅台	59,300	27,980,705.00	3.45
5	000018	神州长城	3,300,000	24,981,000.00	3.08
6	000895	双汇发展	1,000,028	23,750,665.00	2.93
7	002050	三花智控	1,432,100	23,371,872.00	2.88
8	300408	三环集团	1,100,000	23,089,000.00	2.85
9	002074	国轩高科	705,475	22,257,736.25	2.75
10	600887	伊利股份	879,600	18,990,564.00	2.34
11	002831	裕同科技	250,000	18,750,000.00	2.31
12	002311	海大集团	1,000,000	18,270,000.00	2.25
13	000858	五粮液	323,800	18,022,708.00	2.22
14	600066	宇通客车	800,000	17,576,000.00	2.17
15	002008	大族激光	500,000	17,320,000.00	2.14
16	000998	隆平高科	660,264	14,539,013.28	1.79
17	000807	云铝股份	2,000,000	14,440,000.00	1.78
18	002640	跨境通	671,336	14,265,890.00	1.76
19	600497	驰宏锌锗	2,000,000	13,100,000.00	1.62
20	603898	好莱客	349,959	12,231,067.05	1.51
21	601988	中国银行	3,297,000	12,198,900.00	1.51
22	002479	富春环保	989,696	11,777,382.40	1.45

23	002310	东方园林	700,000	11,704,000.00	1.44
24	600110	诺德股份	800,000	11,272,000.00	1.39
25	601633	长城汽车	800,000	10,632,000.00	1.31
26	600027	华电国际	2,199,200	10,622,136.00	1.31
27	000661	长春高新	79,980	10,326,217.80	1.27
28	600030	中信证券	600,000	10,212,000.00	1.26
29	601601	中国太保	300,000	10,161,000.00	1.25
30	002024	苏宁云商	879,600	9,895,500.00	1.22
31	600114	东睦股份	549,500	9,616,250.00	1.19
32	300335	迪森股份	496,200	9,512,154.00	1.17
33	600031	三一重工	1,099,300	8,937,309.00	1.10
34	603816	顾家家居	150,000	8,817,000.00	1.09
35	002285	世联行	1,000,000	8,020,000.00	0.99
36	002475	立讯精密	250,000	7,310,000.00	0.90
37	600585	海螺水泥	299,936	6,817,545.28	0.84
38	300310	宜通世纪	500,080	6,611,057.60	0.82
39	601939	建设银行	999,954	6,149,717.10	0.76
40	300383	光环新网	439,800	5,963,688.00	0.74
41	603808	歌力思	200,000	5,904,000.00	0.73
42	601919	中远海控	1,000,000	5,350,000.00	0.66
43	601717	郑煤机	670,000	5,219,300.00	0.64
44	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.02
45	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.01
46	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
47	603801	N志邦	1,406	47,522.80	0.01
48	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
49	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
50	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.01
51	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
52	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.00
53	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
54	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
55	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
56	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
57	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
58	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
59	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
60	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
61	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00

62	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
63	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
64	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
65	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
66	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
67	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
68	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
69	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
70	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
71	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
72	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000018	神州长城	57,094,577.82	8.55
2	002241	歌尔股份	42,597,406.71	6.38
3	300408	三环集团	42,298,562.09	6.33
4	600491	龙元建设	33,307,745.11	4.99
5	002074	国轩高科	26,002,385.99	3.89
6	002475	立讯精密	25,805,324.70	3.86
7	002688	金河生物	25,313,061.80	3.79
8	300078	思创医惠	24,185,216.86	3.62
9	002311	海大集团	22,188,604.06	3.32
10	000895	双汇发展	21,950,452.00	3.29
11	601933	永辉超市	19,478,729.99	2.92
12	600887	伊利股份	18,874,099.98	2.82
13	002831	裕同科技	18,434,847.00	2.76
14	002310	东方园林	17,456,501.81	2.61
15	600066	宇通客车	17,061,655.32	2.55
16	000807	云铝股份	17,018,766.21	2.55
17	601006	大秦铁路	16,739,000.00	2.51
18	002008	大族激光	16,496,729.91	2.47
19	002043	兔宝宝	15,954,703.45	2.39

20	601988	中国银行	15,743,479.00	2.36
21	601600	中国铝业	15,408,954.00	2.31
22	600664	哈药股份	14,282,694.38	2.14
23	000998	隆平高科	14,179,335.28	2.12
24	601166	兴业银行	13,448,000.00	2.01

注：本项“买入/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。

7.4.2 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	000018	神州长城	26,207,449.40	3.92
2	002475	立讯精密	25,592,490.10	3.83
3	002688	金河生物	24,547,992.88	3.67
4	300078	思创医惠	23,600,094.46	3.53
5	002241	歌尔股份	21,895,949.82	3.28
6	600183	生益科技	20,924,732.64	3.13
7	300408	三环集团	20,788,936.88	3.11
8	000538	云南白药	18,306,880.12	2.74
9	600104	上汽集团	18,239,837.12	2.73
10	601006	大秦铁路	17,945,541.00	2.69
11	600887	伊利股份	16,559,978.36	2.48
12	002043	兔宝宝	16,391,973.80	2.45
13	600362	江西铜业	16,196,490.24	2.42
14	601336	新华保险	15,555,693.14	2.33
15	002581	未名医药	15,539,217.80	2.33
16	601628	中国人寿	15,376,950.73	2.30
17	600166	福田汽车	15,155,523.00	2.27
18	601689	拓普集团	14,233,366.28	2.13
19	601600	中国铝业	14,085,516.43	2.11
20	601888	中国国旅	13,646,732.00	2.04
21	002174	游族网络	13,455,899.44	2.01

注：本项“买入/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	1,018,689,937.58
卖出股票收入（成交）总额	980,103,673.31

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	81,456,427.20	10.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	43,691,522.10	5.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	125,147,949.30	15.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	599,870	61,522,667.20	7.59
2	113008	电气转债	222,000	23,056,920.00	2.85
3	010303	03 国债(3)	202,250	19,933,760.00	2.46
4	113011	光大转债	129,510	13,607,615.70	1.68
5	110031	航信转债	43,160	4,464,470.40	0.55

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	633,447.28
2	应收证券清算款	4,967,137.34
3	应收股利	-
4	应收利息	1,297,106.03
5	应收申购款	63,306.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,960,996.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113008	电气转债	23,056,920.00	2.85
2	110031	航信转债	4,464,470.40	0.55
3	110032	三一转债	2,562,516.00	0.32

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
41,455	18,982.86	103,983,821.47	13.21%	682,950,830.33	86.79%

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	14,503.49	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2005年1月17日）基金份额总额	1,182,530,117.97
本报告期期初基金份额总额	726,326,444.24
本报告期基金总申购份额	113,733,877.27
减：本报告期基金总赎回份额	53,125,669.71
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	786,934,651.80

§ 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

本报告期无涉及基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情形。

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	
申银万国	2	465,341,583.75	23.33%	433,373.01	24.10%	-
招商证券	2	448,775,159.48	22.50%	417,945.18	23.24%	-

长江证券	4	435,814,124.36	21.85%	362,293.06	20.15%	-
华创证券	1	216,202,387.40	10.84%	201,350.74	11.20%	-
浙商证券	1	183,210,528.81	9.19%	170,622.82	9.49%	-
华泰证券	2	155,218,651.89	7.78%	129,033.85	7.18%	-
齐鲁证券	1	52,062,014.17	2.61%	48,485.31	2.70%	-
宏源证券	1	37,616,518.02	1.89%	35,032.56	1.95%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券退租	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券-退租	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
国元证券退租	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国元证券-已退租	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
申银万国	137,489,609.30	92.13%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	11,747,585.30	7.87%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券退租	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券-退租	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券退租	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券-已退租	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租国元证券交易单元 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增聘长信银利精选混合型证券投资基金基金经理的公告	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 5 日
2	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
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 13 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 14 日
5	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
6	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
7	长信银利精选混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
8	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
9	长信基金管理有限责任公司关于长信银利精选混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 21 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
11	长信银利精选混合型证券投资基金更新的招募说明书（2017年【1】号）及摘要（仅摘要见报）	中证报、证券时报、公司网站	2017年3月2日
12	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
13	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
14	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
15	长信银利精选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、公司网站	2017年3月27日
16	长信基金管理有限责任公司关于养老金客户通过直销中心认购、申购旗下部分基金费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月30日
17	长信基金管理有限责任公司关于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	长信银利精选混合型证券投资基金2017年第1季度报告	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
21	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月12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24日
23	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加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
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交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信银利精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信银利精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信银利精选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、《中国农业银行证券交易资金结算协议》；
- 7、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