

长信量化先锋股票型证券投资基金2015年半年度报告

2015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：2015年8月27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2015年8月24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2015年1月1日起至2015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.....	5
	2.1 基金基本情况.....	5
	2.2 基金产品说明.....	5
	2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
	2.4 信息披露方式.....	6
	2.5 其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
	3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
	3.2 基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	9
	4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
	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.....	11
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
	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.....	13
§5	托管人报告.....	14
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
	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.....	14
	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.....	14
§6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
	6.1 资产负债表.....	15
	6.2 利润表.....	16
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
	6.4 报表附注.....	18
§7	投资组合报告.....	38
	7.1 期末基金资产组合情况.....	38
	7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
	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.....	39
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
	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.....	44
	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.....	44
	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.....	44
	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.....	44
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
	7.12 投资组合报告附注.....	45
§8	基金份额持有人信息.....	47
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
	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情况.....	47
§9	开放式基金份额变动.....	48

§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 备查文件目录.....	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化先锋股票型证券投资基金
基金简称	长信量化先锋股票
场内简称	长信量化
基金主代码	519983
交易代码	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	855,957,141.23份
基金合同存续期	不定期

注：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》。

### 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	本基金属于股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	周永刚	汤嵩彦
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-5566	95559
传真		021-61009800	021-62701216
注册地址		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
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		田丹	牛锡明

注：自2015年7月21日起，叶焯先生担任本基金管理人董事长（法定代表人），本基金管理人正在办理法定代表人的工商变更登记。

## 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
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	上海银城中路68号时代金融中心9楼、上海市浦东新区银城中路188号

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日—2015年6月30日）
本期已实现收益	602,210,237.37
本期利润	488,492,006.95
加权平均基金份额本期利润	0.5329
本期加权平均净值利润率	32.03%
本期基金份额净值增长率	65.00%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2015年6月30日）
期末可供分配利润	885,985,765.41
期末可供分配基金份额利润	1.0351
期末基金资产净值	1,892,182,988.92
期末基金份额净值	2.211
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2015年6月30日）
基金份额累计净值增长率	121.10%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

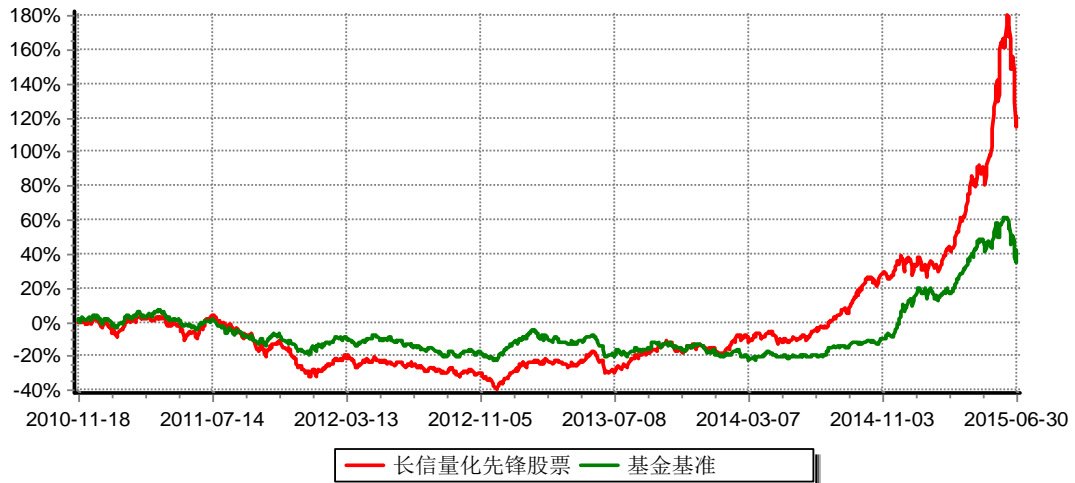
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.35%	3.71%	-5.43%	2.62%	0.08%	1.09%
过去三个月	37.07%	2.76%	8.70%	1.96%	28.37%	0.80%

过去六个月	65.00%	2.22%	20.94%	1.70%	44.06%	0.52%
过去一年	134.22%	1.77%	76.79%	1.38%	57.43%	0.39%
过去三年	196.78%	1.39%	63.97%	1.12%	132.81%	0.27%
自基金合同生效日起 至今（2010年11月18 日-2015年6月30日）	121.10%	1.35%	41.68%	1.07%	79.42%	0.28%

### 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2010年11月18日至2015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，本基金的各项投资比例已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1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2015年6月30日，本基金管理人共管理22只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）（2015年7月20日起变更为长信医疗保健混合（LOF））、长信纯债壹号债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长股票、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合及长信利广混合。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	本基金、长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）、长信量化中小盘股票型证券投资基金的基金经理	2015年3月14日	—	4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，现任本基金和长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）、长信量化中小盘股票型证券投资基金的基金经理。

胡倩	本基金、长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)、长信量化中小盘股票型证券投资基金的基金经理、公司金融工程部总监	2011年4月15日	2015年3月14日	14年	曾任本基金的基金经理。
----	--	------------	------------	-----	-------------

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发现参与交易所证券公开竞价同日反向交易，不涉及成交较少的单边交

易量超过该证券当日成交量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

2015年上半年A股市场整体大幅上涨，各板块表现差异较大，呈现以创业板和中小板为代表的小盘成长股领涨、以沪深300为代表的大盘价值股滞涨的格局。期间上证综指上涨32.23%，沪深300上涨26.58%，中证500上涨67.32%，中小板指数上涨69.06%，创业板综指上涨94.23%。就行业而言，计算机、轻工制造、纺织服装分别以116.36%、104.96%、96.82%的涨幅位列申万一级行业分类的前三名，而有色金属、银行、非银金融分别以39.82%、7.98%、0.88%的涨幅排在28个行业指数的最后三位。各板块、行业在普涨中又有分化是2015年上半年市场运行的主旋律，期间，本基金仓位控制基本符合市场运行规律，在市场热点较多，分化明显的状况下，本基金相对分散的选股和组合构建方式为业绩带来了较大的正向贡献。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金净值为2.211元，本报告期内本基金净值增长率为65.00%，同期业绩比较基准涨幅为20.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纵观上半年股市行情，在央行连续降息降准的政策利好下以及投资者对于改革牛市预期的不断强化，场外资金跑步入市，流动性较为充裕，股市泡沫迅速膨胀。对于杠杆资金的清理刺破了股市泡沫，2015年6月中旬以来股市深幅调整，部分优质成长股已跌入可投资的价值区间。从各宏观经济指标来看，实体经济依然疲软，预计下半年货币政策将加大对实体经济的资金引流，利率上降长稳短，经济基本面会得到进一步改善；相比较货币政策，财政政策在短期内对经济的影响力更为直接，2015年下半年与民生相关的基础设施投资建设有望加码，部分周期性行业也会有投资机会。虽然近期股市波动较大，但改革转型以及居民财富再配置的大逻辑并未改变。面对未来的A股市场，我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，监测市场可能存在的运行规律及发生的

变动，积极谋求对市场状态的理解，实时监控市场动向，通过合理的仓位控制、行业配置以及个股选择，把握未来的投资机会。

#### 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》的规定，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，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监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

2015年上半年度,基金托管人在长信量化先锋股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年上半年度,长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015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股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	508,698,982.51	66,785,813.38
结算备付金		5,509,948.62	12,060,129.69
存出保证金		1,612,161.77	683,135.86
交易性金融资产	6.4.6.2	1,458,237,052.14	1,736,107,614.20
其中：股票投资		1,408,212,052.14	1,686,072,614.20
基金投资		—	—
债券投资		50,025,000.00	50,035,000.00
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		85,151,309.39	23,068,513.99
应收利息	6.4.6.5	2,151,958.21	1,043,692.69
应收股利		—	—
应收申购款		16,584,639.69	13,501,179.54
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		2,077,946,052.33	1,853,250,079.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		—	19,983,131.03
应付赎回款		167,811,401.69	24,298,348.84
应付管理人报酬		2,184,124.63	2,552,023.71

应付托管费		364,020.78	425,337.28
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.6.7	14,536,684.52	5,568,743.20
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	866,831.79	564,425.19
负债合计		185,763,063.41	53,392,009.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	855,957,141.23	1,343,469,056.67
未分配利润	6.4.6.10	1,036,225,847.69	456,389,013.43
所有者权益合计		1,892,182,988.92	1,799,858,070.10
负债和所有者权益总计		2,077,946,052.33	1,853,250,079.35

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值2.211元，基金份额总额855,957,141.23份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015 年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
<b>一、收入</b>		517,847,935.10	12,526,555.14
1. 利息收入		1,895,412.12	58,512.63
其中：存款利息收入	6.4.6.11	719,054.03	58,512.63
债券利息收入		1,043,849.31	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		132,508.78	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		625,679,421.23	8,855,552.02
其中：股票投资收益	6.4.6.12	623,152,237.31	8,102,362.74
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		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.14	—	—



股利收益	6.4.6.15	2,527,183.92	753,189.28
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	-113,718,230.42	3,566,763.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	3,991,332.17	45,726.65
<b>减：二、费用</b>		29,355,928.15	2,448,084.18
1. 管理人报酬		11,419,824.09	884,217.75
2. 托管费		1,903,304.02	147,369.70
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.6.18	15,881,177.14	1,271,678.16
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.6.19	151,622.90	144,818.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		488,492,006.95	10,078,470.96
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		488,492,006.95	10,078,470.96

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015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）	1,343,469,056.67	456,389,013.43	1,799,858,070.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	488,492,006.95	488,492,006.95
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）	-487,511,915.44	91,344,827.31	-396,167,088.13
其中：1. 基金申购款	1,556,163,235.14	1,277,331,522.50	2,833,494,757.64
2. 基金赎回款	-2,043,675,150.58	-1,185,986,695.19	-3,229,661,845.7

			7
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）	855,957,141.23	1,036,225,847.69	1,892,182,988.92
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	119,085,071.97	-17,998,930.62	101,086,141.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	10,078,470.96	10,078,470.96
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）	4,253,443.75	959,709.61	5,213,153.36
其中：1. 基金申购款	60,277,113.70	-4,661,876.75	55,615,236.95
2. 基金赎回款	-56,023,669.95	5,621,586.36	-50,402,083.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	123,338,515.72	-6,960,750.05	116,377,765.67

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：

叶焯

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,募集期为:2010年10月11日至2010年11月12日,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2010年11月18日获得其书面确认(基金部函[2010]669号),本基金基金合同自该日起正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。

经上海众华沪银会计师事务所有限公司验证(沪众会字(2010)第4128号验资报告),本基金有效集中认购份额为324,510,451.15份,募集期间产生的利息为人民币161,246.27元,折成基金份额161,246.27份,本次集中认购实收基金份额共为324,671,697.42份。

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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、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

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### **6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 会计政策变更的说明**

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年3月27日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格进行估值。详情请见本基金管理人于2015年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金交易所固定收益品种估值方法的公告》。

##### **6.4.4.3 差错更正的说明**

本基金本报告期未发生重大会计差错。

#### **6.4.5 税项**

根据财税字[1998]55号文、财税字[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[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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》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:

- 1、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。
- 2、基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、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。
- 4、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, 暂不征收企业所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定, 自2013年1月1日起, 个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 暂减按25%计入应纳税所得额。

- 5、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。

#### 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 2015年6月30日
活期存款	508,698,982.51
定期存款	—
其中: 存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	508,698,982.51

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,442,542,344.42	1,408,212,052.14	-34,330,292.28
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	49,979,350.00	50,025,000.00	45,650.00
	合计	49,979,350.00	50,025,000.00	45,650.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,492,521,694.42	1,458,237,052.14	-34,284,642.28

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	60,894.79
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	2,235.61
应收债券利息	2,053,095.89
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	35,078.97
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	652.95
合计	2,151,958.21

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.6.6 其他资产

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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	14,536,539.52
银行间市场应付交易费用	145.00
合计	14,536,684.52

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	628,442.47
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
预提审计费	34,712.18
合计	866,831.79

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,343,469,056.67	1,343,469,056.67
本期申购	1,556,163,235.14	1,556,163,235.14
本期赎回（以“-”号填列）	-2,043,675,150.58	-2,043,675,150.58
本期末	855,957,141.23	855,957,141.23

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	196,925,290.42	259,463,723.01	456,389,013.43
本期利润	602,210,237.37	-113,718,230.42	488,492,006.95
本期基金份额交易产生的变动数	86,850,237.62	4,494,589.69	91,344,827.31
其中：基金申购款	763,659,321.94	513,672,200.56	1,277,331,522.50
基金赎回款	-676,809,084.32	-509,177,610.87	-1,185,986,695.19

本期已分配利润	—	—	—
本期末	885,985,765.41	150,240,082.28	1,036,225,847.69

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	464,109.84
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	222,829.96
其他	32,114.23
合计	719,054.03

注：其他为申购款利息收入19,538.72元，保证金利息收入12,575.51元。

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	623,152,237.31
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	623,152,237.31

##### 6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	5,694,713,762.79
减：卖出股票成本总额	5,071,561,525.48
买卖股票差价收入	623,152,237.31

#### 6.4.6.13 债券投资收益

本基金本报告期末无债券投资收益。

#### 6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,527,183.92
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,527,183.92

#### 6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-113,718,230.42
——股票投资	-113,708,230.42
——债券投资	-10,000.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-113,718,230.42

#### 6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	3,566,621.67
转换费收入	424,710.50
合计	3,991,332.17

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

#### 6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	15,881,177.14
银行间市场交易费用	—
合计	15,881,177.14

#### 6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

审计费用	34,712.18
信息披露费	99,177.14
交易费用_回购	—
权证	—
账户维护费	9,000.00
其他费用	8,733.58
合计	151,622.90

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

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

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 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(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	5,339,957,554.23	50.37%	325,485,803.24	39.22%

### 6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	占应付佣金总额的比例
长江证券	4,669,532.22	52.07%	8,670,430.57	59.65%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	占应付佣金总额的比例
长江证券	296,323.03	39.22%	168,008.96	37.70%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费-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)

上述交易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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	11,419,824.09
其中：支付销售机构的客户维护费	3,801,537.22	296,145.29

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,903,304.02	147,369.70

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

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
报告期初持有的基金份额	—	20,000,400.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	20,000,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	16.22%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期及上年度可比期间均未投资过本基金。

#### 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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	508,698,982.51	464,109.84	13,543,199.15	51,718.24
------------	----------------	------------	---------------	-----------

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2015年6月30日的相关余额为人民币5,509,948.62元（2014年12月31日：人民币12,060,129.69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

本基金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

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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2015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

截至本报告期末，本基金未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600167	联美控股	2015/5/27	重大事项停牌	25.19	—	—	311,800	6,362,295.13	7,854,242.00	
600355	精伦电子	2015/6/29	重大事项停牌	20.71	—	—	915,900	18,789,691.00	18,968,289.00	
600393	东华实业	2015/6/18	重大事项停牌	14.51	2015/7/1	15.85	1,017,393	10,900,067.46	14,762,372.43	
600719	大连热电	2015/3/26	重大事项停牌	14.83	—	—	375,301	3,877,302.10	5,565,713.83	
601877	正泰电器	2015/5/18	重大事项停牌	30.81	—	—	3	83.92	92.43	
000586	汇源通信	2015/5/25	重大事项停牌	16.49	2015/7/17	17.02	574,001	8,260,007.80	9,465,276.49	
000608	阳光股份	2015/5/25	重大事项停牌	7.7	2015/8/21	7.41	845,900	5,613,228.60	6,513,430.00	

000691	亚太实业	2015/5/12	重大事项停牌	10.41	2015/8/19	9.12	622,800	5,958,792.00	6,483,348.00	
000708	大冶特钢	2015/5/13	重大事项停牌	14.87	—	—	167,000	2,450,466.00	2,483,290.00	
000786	北新建材	2015/4/10	重大事项停牌	19.13	—	—	26	322.69	497.38	
000959	首钢股份	2015/4/23	重大事项停牌	6.19	—	—	320,900	1,569,845.00	1,986,371.00	
002020	京新药业	2015/4/16	重大事项停牌	29.44	2015/8/10	26.10	576,201	12,929,190.27	16,963,357.44	
002203	海亮股份	2015/4/27	重大事项停牌	11.82	—	—	30	286.25	354.6	
002209	达意隆	2015/6/8	重大事项停牌	20.14	2015/7/13	23.89	308,089	4,916,257.47	6,204,912.46	
002214	大立科技	2015/6/15	重大事项停牌	15.42	—	—	563,348	8,759,261.94	8,686,826.16	
002268	卫神通	2015/5/8	重大事项停牌	80.14	2015/8/4	76.32	120	5,527.85	9,616.80	
002278	神开股份	2015/5/26	重大事项停牌	13.35	—	—	629,257	8,096,055.22	8,400,580.95	
002292	奥飞动漫	2015/5/18	重大事项停牌	37.29	—	—	122	2,284.55	4,549.38	
002359	齐星铁塔	2014/11/13	重大事项停牌	12	2015/7/3	7.02	2,487,598	18,115,115.47	29,851,176.00	
002377	国创高新	2015/6/26	重大事项停牌	13.32	2015/7/3	11.99	1,094,677	12,568,072.30	14,581,097.64	
002388	新亚制程	2015/5/20	重大事项停牌	26.74	2015/8/20	12.87	392,650	8,234,832.17	10,499,461.00	
002511	中顺洁柔	2015/6/1	重大事项停牌	12.61	2015/7/14	12.76	490,823	6,007,291.44	6,189,278.03	
002557	洽洽食品	2015/6/29	重大事项停牌	16.38	2015/8/24	14.74	847,012	17,997,682.67	13,874,056.56	
002591	恒大高新	2015/6/24	重大事项停牌	19.95	2015/7/17	17.96	753,411	10,970,742.13	15,030,549.45	
002662	京威股份	2015/5/15	重大事项停牌	17.82	2015/8/13	16.06	24	313.08	427.68	
002669	康达新材	2015/5/11	重大事项停牌	24.1	2015/8/4	19.99	291,800	5,177,011.85	7,032,380.00	
300071	华谊嘉信	2015/5/21	重大事项停牌	12.95	—	—	529,151	6,893,195.30	6,852,505.45	
300084	海默科技	2015/6/2	重大事项停牌	18.95	2015/7/20	19.29	647,657	13,487,187.43	12,273,100.15	

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因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

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动风险

利率风险

外汇风险

其他市场价格风险

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。

本基金管理人已制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以投资决策委员会、内部控制委员会为核心的、由金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，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民生银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日

A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	50,025,000.00	50,035,000.00
合计	50,025,000.00	50,035,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

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，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，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
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

#### 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，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注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。

本基金管理人金融工程部每日预测本基金的流动性需求，并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。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。本基金管理人金融工程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 2015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	508,698,982.51	—	—	—	—	508,698,982.51
结算备付金	5,509,948.62	—	—	—	—	5,509,948.62
存出保证金	1,612,161.77	—	—	—	—	1,612,161.77
交易性金融资产	50,025,000.00	—	—	—	1,408,212,052.14	1,458,237,052.14
应收证券清算款	—	—	—	—	85,151,309.39	85,151,309.39
应收利息	—	—	—	—	2,151,958.21	2,151,958.21
应收申购款	—	—	—	—	16,584,639.69	16,584,639.69
资产总计	565,846,092.90	—	—	—	1,512,099,959.43	2,077,946,052.33
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	167,811,401.69	167,811,401.69
应付管理人报酬	—	—	—	—	2,184,124.63	2,184,124.63

应付托管费	—	—	—	—	364,020.78	364,020.78
应付交易费用	—	—	—	—	14,536,684.52	14,536,684.52
其他负债	—	—	—	—	866,831.79	866,831.79
负债总计	—	—	—	—	185,763,063.41	185,763,063.41
利率敏感度缺口	565,846,092.90	—	—	—	1,326,336,896.02	1,892,182,988.92
上年度末 2014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	66,785,813.38	—	—	—	—	66,785,813.38
结算备付金	12,060,129.69	—	—	—	—	12,060,129.69
存出保证金	683,135.86	—	—	—	—	683,135.86
交易性金融资产	—	50,035,000.00	—	—	1,686,072,614.20	1,736,107,614.20
应收证券清算款	—	—	—	—	23,068,513.99	23,068,513.99
应收利息	—	—	—	—	1,043,692.69	1,043,692.69
应收申购款	—	—	—	—	13,501,179.54	13,501,179.54
资产总计	79,529,078.93	50,035,000.00	—	—	1,723,686,000.42	1,853,250,079.35
负债						
应付证券清算款	—	—	—	—	19,983,131.03	19,983,131.03
应付赎回款	—	—	—	—	24,298,348.84	24,298,348.84
应付管理人报酬	—	—	—	—	2,552,023.71	2,552,023.71
应付托管费	—	—	—	—	425,337.28	425,337.28
应付交易费用	—	—	—	—	5,568,743.20	5,568,743.20
其他负债	—	—	—	—	564,425.19	564,425.19
负债总计	—	—	—	—	53,392,009.25	53,392,009.25
利率敏感度缺口	79,529,078.93	50,035,000.00	—	—	1,670,293,991.17	1,799,858,070.10

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新

定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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 （2015年6月30日）	上年度末 （2014年12月31日）
	市场利率下降27个基点	3,651.43	67.967.84
	市场利率上升27个基点	-3,651.43	-67.967.84

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的76.24%，债券投资比例为基金资产净值的2.64%。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 2015年6月30日		上年度末 2014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	1,408,212,052.14	74.42	1,686,072,614.20	93.68
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	50,025,000.00	2.64	50,035,000.00	2.78
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	1,458,237,052.14	77.06	1,736,107,614.20	96.46
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 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 (2015年6月30日)	上年度末 (2014年12月31日)
	VaR值为2.34% (2014年为1.76%)	-44,277,081.94	-31,677,502.03

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工具金融工具。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。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2015年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

资产	本期末 2015年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	1,177,674,899.83	230,537,152.31	—	1,408,212,052.14
债券投资	—	50,025,000.00	—	50,025,000.00
合计	1,177,674,899.83	280,562,152.31	—	1,458,237,052.14

本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期，本基金金融工具的公允价值估值技术并未发生改变。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,408,212,052.14	67.77
	其中：股票	1,408,212,052.14	67.77
2	固定收益投资	50,025,000.00	2.41
	其中：债券	50,025,000.00	2.41
	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	514,208,931.13	24.75
7	其他资产	105,500,069.06	5.08
8	合计	2,077,946,052.33	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	43,890,912.87	2.32
B	采矿业	12,273,100.15	0.65
C	制造业	995,718,928.36	52.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,903,448.39	2.06
E	建筑业	32,658,769.00	1.73
F	批发和零售业	93,518,600.27	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	11,974,774.42	0.63
H	住宿和餐饮业	11,918,325.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,229,939.53	3.50
J	金融业	—	—
K	房地产业	27,759,150.43	1.47
L	租赁和商务服务业	6,853,035.21	0.36
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	27,877,542.08	1.47
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	13,276,545.66	0.70
S	综合	25,358,980.77	1.34
	合计	1,408,212,052.14	74.42

### 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	002359	齐星铁塔	2,487,598	29,851,176.00	1.58
2	600189	吉林森工	1,154,800	21,202,128.00	1.12
3	600248	延长化建	1,527,593	20,714,161.08	1.09
4	002088	鲁阳股份	1,184,253	19,765,182.57	1.04
5	002560	通达股份	744,684	19,406,465.04	1.03
6	600355	精伦电子	915,900	18,968,289.00	1.00
7	002719	麦趣尔	264,692	18,531,086.92	0.98
8	002360	同德化工	1,031,847	18,366,876.60	0.97
9	600272	开开实业	1,012,616	18,277,718.80	0.97
10	002243	通产丽星	1,270,310	17,530,278.00	0.93
11	000570	苏常柴A	1,073,994	17,183,904.00	0.91
12	002020	京新药业	576,201	16,963,357.44	0.90
13	600356	恒丰纸业	1,472,834	16,613,567.52	0.88
14	000957	中通客车	684,766	16,523,403.58	0.87
15	600802	福建水泥	1,517,700	16,512,576.00	0.87
16	300106	西部牧业	649,949	16,508,704.60	0.87
17	600379	宝光股份	818,029	16,082,450.14	0.85
18	000004	国农科技	417,000	16,054,500.00	0.85
19	600523	贵航股份	513,143	15,820,198.69	0.84
20	600231	凌钢股份	1,842,759	15,147,478.98	0.80
21	002591	恒大高新	753,411	15,030,549.45	0.79
22	600393	东华实业	1,017,393	14,762,372.43	0.78
23	002377	国创高新	1,094,677	14,581,097.64	0.77
24	000430	张家界	1,075,360	14,571,128.00	0.77
25	002150	通润装备	1,023,610	14,494,317.60	0.77
26	002472	双环传动	448,814	14,474,251.50	0.76
27	600218	全柴动力	1,012,737	14,461,884.36	0.76
28	002234	民和股份	906,902	14,401,603.76	0.76

29	002222	福晶科技	732,669	14,279,718.81	0.75
30	600345	长江通信	652,300	14,239,709.00	0.75
31	000785	武汉中商	879,219	14,111,464.95	0.75
32	002449	国星光电	639,240	14,063,280.00	0.74
33	300137	先河环保	609,202	13,938,541.76	0.74
34	002323	中联电气	432,879	13,930,046.22	0.74
35	300275	梅安森	470,820	13,926,855.60	0.74
36	603123	翠微股份	1,022,079	13,900,274.40	0.73
37	600480	凌云股份	589,395	13,886,146.20	0.73
38	002557	洽洽食品	847,012	13,874,056.56	0.73
39	600605	汇通能源	639,110	13,740,865.00	0.73
40	600475	华光股份	672,564	13,686,677.40	0.72
41	002452	长高集团	1,310,730	13,618,484.70	0.72
42	600781	辅仁药业	566,685	13,589,106.30	0.72
43	600985	雷鸣科化	603,925	13,425,252.75	0.71
44	002561	徐家汇	808,982	13,348,203.00	0.71
45	300132	青松股份	1,177,462	13,340,644.46	0.71
46	600706	曲江文旅	634,848	13,306,414.08	0.70
47	002149	西部材料	467,049	13,292,214.54	0.70
48	601999	出版传媒	933,653	13,276,545.66	0.70
49	600529	山东药玻	790,449	13,208,402.79	0.70
50	002615	哈尔斯	560,829	13,179,481.50	0.70
51	601137	博威合金	512,071	13,160,224.70	0.70
52	600603	大洲兴业	778,389	13,146,990.21	0.69
53	300225	金力泰	1,417,094	13,093,948.56	0.69
54	002134	天津普林	996,788	13,087,826.44	0.69
55	002423	中原特钢	808,592	13,058,760.80	0.69
56	600982	宁波热电	1,412,104	13,047,840.96	0.69
57	300313	天山生物	571,581	12,980,604.51	0.69
58	002082	栋梁新材	901,685	12,975,247.15	0.69
59	000407	胜利股份	1,444,260	12,882,799.20	0.68
60	002536	西泵股份	253,097	12,824,424.99	0.68
61	002380	科远股份	217,399	12,756,973.32	0.67
62	300114	中航电测	289,585	12,738,844.15	0.67
63	002420	毅昌股份	1,112,206	12,556,805.74	0.66
64	002213	特尔佳	808,089	12,533,460.39	0.66
65	002562	兄弟科技	639,434	12,532,906.40	0.66
66	300260	新莱应材	368,799	12,494,910.12	0.66
67	300265	通光线缆	896,719	12,473,361.29	0.66
68	600213	亚星客车	933,606	12,472,976.16	0.66



69	002182	云海金属	794,748	12,469,596.12	0.66
70	000605	渤海股份	482,002	12,435,651.60	0.66
71	300084	海默科技	647,657	12,273,100.15	0.65
72	600082	海泰发展	1,336,104	12,211,990.56	0.65
73	002609	捷顺科技	610,218	12,204,360.00	0.64
74	300194	福安药业	454,000	12,008,300.00	0.63
75	300290	荣科科技	300,089	11,997,558.22	0.63
76	002492	恒基达鑫	767,122	11,974,774.42	0.63
77	000628	高新发展	820,263	11,943,029.28	0.63
78	300108	双龙股份	700,883	11,929,028.66	0.63
79	000524	岭南控股	550,500	11,918,325.00	0.63
80	002058	威尔泰	566,429	11,912,001.87	0.63
81	600241	时代万恒	813,992	11,843,583.60	0.63
82	002580	圣阳股份	657,400	11,662,276.00	0.62
83	300160	秀强股份	493,197	11,294,211.30	0.60
84	002388	新亚制程	392,650	10,499,461.00	0.55
85	300245	天玑科技	424,973	10,288,596.33	0.54
86	300282	汇冠股份	184,079	9,905,290.99	0.52
87	002139	拓邦股份	413,300	9,642,289.00	0.51
88	300200	高盟新材	617,925	9,602,554.50	0.51
89	000586	汇源通信	574,001	9,465,276.49	0.50
90	600476	湘邮科技	248,514	9,396,314.34	0.50
91	002214	大立科技	563,348	8,686,826.16	0.46
92	000723	美锦能源	507,000	8,553,090.00	0.45
93	300330	华虹计通	419,912	8,406,638.24	0.44
94	002278	神开股份	629,257	8,400,580.95	0.44
95	600828	成商集团	794,683	8,296,490.52	0.44
96	002328	新朋股份	566,245	7,927,430.00	0.42
97	600167	联美控股	311,800	7,854,242.00	0.42
98	002136	安纳达	544,600	7,580,832.00	0.40
99	002669	康达新材	291,800	7,032,380.00	0.37
100	002433	太安堂	426,354	6,889,880.64	0.36
101	300071	华谊嘉信	529,151	6,852,505.45	0.36
102	000608	阳光股份	845,900	6,513,430.00	0.34
103	000691	亚太实业	622,800	6,483,348.00	0.34
104	300062	中能电气	306,669	6,271,381.05	0.33
105	002209	达意隆	308,089	6,204,912.46	0.33
106	002511	中顺洁柔	490,823	6,189,278.03	0.33
107	601677	明泰铝业	359,952	5,892,414.24	0.31
108	300317	珈伟股份	170,423	5,685,311.28	0.30

109	600719	大连热电	375,301	5,565,713.83	0.29
110	002547	春兴精工	104,000	3,609,840.00	0.19
111	000708	大冶特钢	167,000	2,483,290.00	0.13
112	000959	首钢股份	320,900	1,986,371.00	0.10
113	600613	神奇制药	45,539	1,153,958.26	0.06
114	002268	卫士通	120	9,616.80	0.00
115	002292	奥飞动漫	122	4,549.38	0.00
116	600521	华海药业	112	3,500.00	0.00
117	002701	奥瑞金	130	3,383.90	0.00
118	002019	亿帆鑫富	75	2,572.50	0.00
119	002426	胜利精密	94	2,068.00	0.00
120	002249	大洋电机	128	1,640.96	0.00
121	002081	金螳螂	56	1,578.64	0.00
122	600444	*ST国通	70	1,528.10	0.00
123	000415	渤海租赁	56	529.76	0.00
124	000786	北新建材	26	497.38	0.00
125	002662	京威股份	24	427.68	0.00
126	002203	海亮股份	30	354.60	0.00
127	601877	正泰电器	3	92.43	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	300137	先河环保	31,252,929.88	1.74
2	000961	中南建设	28,313,936.92	1.57
3	600801	华新水泥	27,404,617.64	1.52
4	002088	鲁阳股份	25,972,714.21	1.44
5	000063	中兴通讯	25,688,750.04	1.43
6	600272	开开实业	25,639,568.48	1.42
7	600007	中国国贸	25,563,895.47	1.42
8	002560	通达股份	25,519,589.04	1.42
9	601099	太平洋	25,410,980.28	1.41
10	000686	东北证券	24,588,079.53	1.37
11	601555	东吴证券	24,355,951.62	1.35
12	600345	长江通信	24,201,227.39	1.34
13	600248	延长化建	24,159,048.32	1.34
14	600356	恒丰纸业	22,792,846.16	1.27
15	000002	万科A	22,110,033.55	1.23

16	600089	特变电工	21,738,969.26	1.21
17	600012	皖通高速	21,412,312.04	1.19
18	603993	洛阳钼业	21,132,494.73	1.17
19	002081	金螳螂	21,043,026.44	1.17
20	600395	盘江股份	20,938,541.58	1.16

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	002131	利欧股份	57,621,248.15	3.20
2	002044	江苏三友	49,060,308.39	2.73
3	601186	中国铁建	42,859,621.08	2.38
4	600015	华夏银行	37,183,194.69	2.07
5	000040	宝安地产	34,050,204.64	1.89
6	603993	洛阳钼业	33,916,708.78	1.88
7	600201	金宇集团	33,274,506.86	1.85
8	002179	中航光电	33,266,846.54	1.85
9	002642	荣之联	32,558,337.52	1.81
10	000671	阳光城	32,372,613.57	1.80
11	002267	陕天然气	32,206,912.23	1.79
12	601139	深圳燃气	32,165,219.35	1.79
13	002081	金螳螂	31,262,000.49	1.74
14	600395	盘江股份	31,181,601.93	1.73
15	601801	皖新传媒	31,053,401.47	1.73
16	002051	中工国际	30,676,749.33	1.70
17	600548	深高速	30,612,092.06	1.70
18	600270	外运发展	30,505,918.18	1.69
19	000686	东北证券	30,328,008.12	1.69
20	600483	福能股份	30,178,150.24	1.68

注：本项“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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,907,409,193.84
卖出股票的收入（成交）总额	5,694,713,762.79

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	50,025,000.00	2.64
	其中：政策性金融债	50,025,000.00	2.64
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	50,025,000.00	2.64

### 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	140218	14国开18	500,000	50,025,000.00	2.64

### 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

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

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

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

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

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中，齐星铁塔（002359）的发行主体于2015年4月4日发布公告称其收到中国证券监督管理委员会调查通知书（鲁证调查通字15048号），因公司涉嫌信息披露违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司进行立案调查。发行主体于2015年5月8日收到深圳证券交易所《关于对山东齐星铁塔科技股份有限公司及相关当事人给予处分的决定》，深圳证券交易所因公司信息披露违规对其给予通报批评的处分。发行主体于2014年6月3日发布公告称其收到中国证券监督管理委员会山东监管局《行政处罚决定书》（【2015】1号）。2013年、2014年度公司与原第一大股东齐星集团有限公司等关联方之间发生非经营性资金往来业务，公司未及时履行临时信息披露义务，亦未在公司2013年中期报告、2013年年度报告及2014年中期报告中披露该重要事项。2014年度，公司对两笔银行贷款业务及其与齐星集团有限公司等关联方之间发生的部分非经营性资金往来事项未按规定进行会计确认和计量，导致公司2014年第一季度报告、中期报告、第三季度报告的个别列表项目存在虚假记载。山东监管局针对上述事实对公司及相关当事人进行了相应处罚。

对该股票投资决策程序的说明：本基金采用数量化投资策略建立投资模型，选股模型重点考察股票相对盈利、估值、成长性、回报率、市场交易数据等指标，建立指标与收益率之间的关联关系，并运用数学和统计检验方法，筛选出能在大概率上战胜市场的股票组合。金融工程部通过上述模型将该股票纳入基金投资对象备选库并进行投资。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期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	1,612,161.77
2	应收证券清算款	85,151,309.39
3	应收股利	—
4	应收利息	2,151,958.21
5	应收申购款	16,584,639.69
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	105,500,069.06

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	002359	齐星铁塔	29,851,176.00	1.58	停牌或网下申购锁定期
2	600355	精伦电子	18,968,289.00	1.00	停牌或网下申购锁定期

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
35,607	24,039.01	361,642,356.61	42.25%	494,314,784.62	57.75%

### 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	210,168.07	0.02%

### 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(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	1,343,469,056.67
本报告期基金总申购份额	1,556,163,235.14
减：本报告期基金总赎回份额	2,043,675,150.58
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	855,957,141.23



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本报告期内，原董事长田丹先生离职，覃波先生自2015年4月28日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）叶焯先生自2015年7月21日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自2015年4月29日起，本基金管理人增聘邵彦明先生、李小羽先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《关于基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 10.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	5,339,957,554.23	50.37%	4,669,532.22	52.07%	
华泰证券	2	1,409,218,332.31	13.29%	1,142,032.86	12.73%	
海通证券	1	1,242,736,571.94	11.72%	1,007,115.42	11.23%	
兴业证券	2	852,876,074.93	8.04%	691,171.63	7.71%	
光大证券	1	542,562,643.34	5.12%	439,692.56	4.90%	
申银万国	1	531,690,591.89	5.02%	430,882.80	4.80%	
国泰君安	1	346,185,153.44	3.27%	315,167.70	3.51%	
国金证券	1	336,223,355.15	3.17%	272,475.88	3.04%	
广发证券	2	0	0.00%	0	0.00%	
华创证券	1	0	0.00%	0	0.00%	

注：1、本报告期内本基金增加租用华泰证券的交易单元2个，增加租用兴业证券的交易单元2个，广发证券的交易单元2个，光大证券的交易席位1个，国金证券的交易单元1个，申银万国的交易单元1个。

### 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔1998〕29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

#### （1）选择标准：

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

#### （2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，

然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2014年12月31日资产净值的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-1
2	长信基金管理有限责任公司关于增加西南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定期定额投资业务及转换业务的公告	上证报、中证报 证券时报、证券 日报	2015-1-15
3	长信量化先锋股票型证券投资基金2014年第4季度报告	中证报、证券时 报	2015-1-21
4	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋股票型证券投资基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司申购费率优惠活动的公告	中证报、证券时 报	2015-1-24
5	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在中国工商银行股份有限公司开通转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-4
6	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齐鲁证券有限公司网上交易系统申购、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	2015-3-11
7	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋股票型证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-14
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在长江证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务并参加基金网上交易系统及手机证券交易系统申购、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、证券 日报	2015-3-23
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在中山证券有限责任公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购、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、证券 日报	2015-3-23
10	长信量化先锋股票型证券投资基金2014年年报及摘要	中证报、证券时 报	2015-3-28
11	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、证券 日报	2015-3-30
12	长信量化先锋股票型证券投资基金2015年第1季	中证报、证券时	2015-4-20

	度报告	报	
13	长信基金管理有限责任公司关于增加广州证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报	2015-4-29
14	长信基金管理有限责任公司关于在平安银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金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	2015-5-12
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金继续参加重庆银行股份有限公司基金网上申购和定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中证报、上证报、 证券时报	2015-5-20
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中国农业银行股份有限公司网上银行、手机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	2015-5-29
17	长信基金管理有限责任公司关于增加宜信普泽投资顾问(北京)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、参加申购(含定投申购)费率优惠活动及开通转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报	2015-6-11
18	长信基金管理有限责任公司关于在第一创业证券股份有限公司开通旗下部分开放式基金的定期定额投资业务并参加基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券 日报	2015-6-25
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网上银行、手机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、证券 日报	2015-6-29

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准长信量化先锋股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化先锋股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

二〇一五年八月二十七日