

长信量化多策略股票型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司，根据本基金合同规定，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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 长信量化多策略股票 |
| 场内简称 | 量化策略 |
| 基金主代码 | 519965 |
| 交易代码 | 519965 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 7 月 14 日 |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 263,624,670.87 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|----------------------|---------------------|
| 名称 | | 长信基金管理有限责任公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 95588 |
| 传真 | | 021-61009800 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--|
| 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 55 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 | -11,843,949.20 |
| 本期利润 | -18,080,963.37 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0816 |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.57% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2114 |
| 期末基金资产净值 | 319,360,506.67 |
| 期末基金份额净值 | 1.211 |

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。

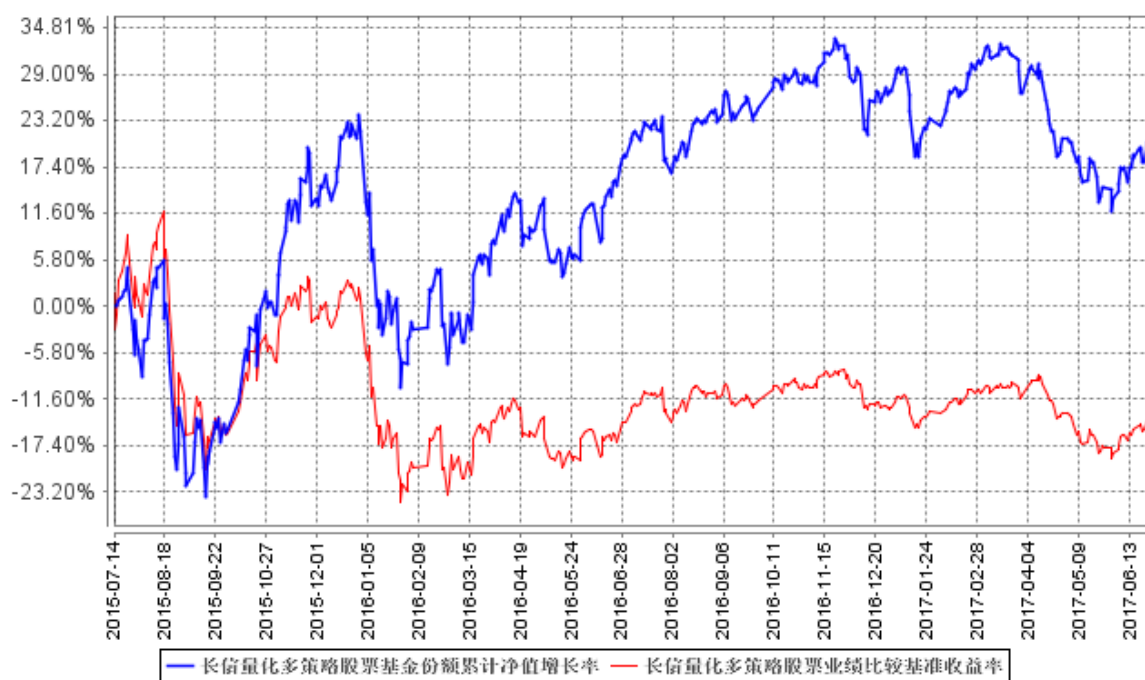
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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% | 1.06% | 4.53% | 0.75% | 1.14% | 0.31% |
| 过去三个月 | -4.34% | 1.10% | -3.21% | 0.82% | -1.13% | 0.28% |
| 过去六个月 | -4.57% | 1.04% | -1.51% | 0.72% | -3.06% | 0.32% |
| 过去一年 | 1.76% | 1.02% | 0.48% | 0.73% | 1.28% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.10% | 1.95% | -14.05% | 1.65% | 35.15% | 0.30% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2015 年 7 月 14 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 | | |
| 常松 | 长信量化多策略股票型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理、公司总经理助理、混合策略部总监、投资决策委员会执行委员 | 2015年9月25日 | - | 13年 | 管理学博士，东南大学管理科学与工程专业博士生毕业，具有基金从业资格。曾任富国基金管理有限公司研究员，北京尊嘉资产管理有限公司投资经理，中原证券股份有限公司投资主办，2015年4月加入长信基金管理有限责任公司，曾任量化投资部总监，现任总经理助理、混合策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 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 | 2015年7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 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | <p>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</p> | | | <p>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。</p> |
|--|---|--|--|--|

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；

3、自 2017 年 8 月 1 日起，常松先生开始担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

前期我们对市场的观点是，在低波动率和低成交量的市场中，未来更有可能维持之前的趋势，也就是市场将维持偏震荡向上的格局。同时，在这种偏震荡向上的格局中，结构上、局部上形成赚钱效应，相对而言我们更看好已经经历过较长时间和较大幅度调整的中小盘股票。

回顾 2017 年上半年行情，上证 50 指数涨幅 11.50%，沪深 300 指数涨幅 10.78%，中证 500 指数涨幅-2.00%，中证 1000 指数涨幅-12.07%。市场表现出强烈的一九效应，大小盘风格之间的差异不仅没有收敛，反而是愈演愈烈，延续了 2016 年 4 季度以来的风格分化。上证 50 指数和中证 1000 指数差异超过 20%，历史上罕见。

本基金期间净值涨幅-4.57%，涨幅小于本基金的业绩比较基准。本基金持股风格偏向中小盘股票，中小盘股票持续弱势是本基金当季表现不佳的主要原因。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.211 元，份额累计净值为 1.211 元，本报告期基金净值增长率为-4.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，我们仍然维持市场整体震荡向上的看法。从 2016 年以来，市场呈现出明显的波动率和成交量都越来越低的特征，表明 2015 年以来的投资者恐慌情绪基本缓解。从历史经验来看，低波动率和低成交量的市场中，未来更有可能维持之前的趋势，也就是市场在未来将继续维持偏震荡向上的格局。同时，在这种偏震荡向上的格局中，结构上、局部上形成赚钱效应。

2016 年 4 季度以来的最近 3 个季度，局部赚钱效应体现在大盘股票上，但我们预期未来更多的局部赚钱效应会体现在小盘股上，从估值来讲，经过前期较长时间调整，与历史相比，小盘股的估值溢价已经大幅度回落，处于历史中枢相对合理的位置，部分基本面良好的中小盘股票被错杀。从成长性来讲，在整个实体经济偏弱大背景下，成长性更高的小盘股更具有稀缺性。我们组合配置的重点将是成长性良好、估值合理、前期跌幅较大被错杀的中小股票。

我们将积极布局，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》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长信量化多策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，长信量化多策略股票型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信量化多策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信量化多策略股票型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：长信量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 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 | 49,634,909.45 | 36,289,468.45 |
| 结算备付金 | 917,288.84 | 914,876.66 |
| 存出保证金 | 84,421.03 | 42,683.56 |
| 交易性金融资产 | 269,659,222.86 | 177,441,468.82 |
| 其中：股票投资 | 269,659,222.86 | 177,441,468.82 |
| 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 301,114.81 | - |
| 应收利息 | 9,822.25 | 6,623.68 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 464,028.97 | 867,963.42 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 321,070,808.21 | 215,563,084.59 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2017 年 6 月 30 日 | 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | 3,981,124.65 |
| 应付赎回款 | 773,864.91 | 1,271,339.80 |
| 应付管理人报酬 | 364,952.18 | 252,784.17 |
| 应付托管费 | 60,825.37 | 42,130.71 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 315,504.11 | 342,300.17 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 195,154.97 | 262,612.87 |
| 负债合计 | 1,710,301.54 | 6,152,292.37 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 263,624,670.87 | 164,987,040.12 |
| 未分配利润 | 55,735,835.80 | 44,423,752.10 |
| 所有者权益合计 | 319,360,506.67 | 209,410,792.22 |
| 负债和所有者权益总计 | 321,070,808.21 | 215,563,084.59 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.211，基金份额总额 263,624,670.87 份。

6.2 利润表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 | 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 |
| 一、收入 | -14,446,450.10 | 1,084,512.25 |
| 1.利息收入 | 177,324.38 | 60,944.42 |
| 其中：存款利息收入 | 171,354.93 | 60,944.42 |
| 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 | 5,969.45 | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -9,144,937.59 | 3,351,939.95 |
| 其中：股票投资收益 | -11,071,973.30 | 2,807,099.87 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,927,035.71 | 544,840.08 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -6,237,014.17 | -2,467,945.59 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 758,177.28 | 139,573.47 |
| 减：二、费用 | 3,634,513.27 | 1,483,144.67 |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|--------------------|
| 1. 管理人报酬 | 2,025,293.65 | 814,206.50 |
| 2. 托管费 | 337,548.96 | 135,701.11 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 1,147,404.52 | 404,225.90 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 124,266.14 | 129,011.16 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -18,080,963.37 | -398,632.42 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -18,080,963.37 | -398,632.42 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 164,987,040.12 | 44,423,752.10 | 209,410,792.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -18,080,963.37 | -18,080,963.37 |
| 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） | 98,637,630.75 | 29,393,047.07 | 128,030,677.82 |
| 其中：1.基金申购款 | 244,276,707.13 | 64,175,282.28 | 308,451,989.41 |
| 2.基金赎回款 | -145,639,076.38 | -34,782,235.21 | -180,421,311.59 |
| 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） | 263,624,670.87 | 55,735,835.80 | 319,360,506.67 |
| 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) | 91,232,771.78 | 19,909,591.19 | 111,142,362.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -398,632.42 | -398,632.42 |
| 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) | 6,709,017.82 | -908,241.74 | 5,800,776.08 |
| 其中：1.基金申购款 | 41,880,352.97 | 2,036,328.13 | 43,916,681.10 |
| 2.基金赎回款 | -35,171,335.15 | -2,944,569.87 | -38,115,905.02 |
| 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) | 97,941,789.60 | 18,602,717.03 | 116,544,506.63 |

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

长信量化多策略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”）《关于准予长信量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]742号批准，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《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年7月14日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为648,523,672.21份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化多策略股票型证券投资基

金基金合同》和《长信量化多策略股票型证券投资基金更新的招募说明书》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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例为 5%-20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人 |

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.7.1.2 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。

6.4.7.1.3 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。

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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 | 2,025,293.65 | 814,206.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 721,349.22 | 458,705.97 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.7.2.2 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 | 337,548.96 | 135,701.11 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 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 | |
|-----------------------|--|---|---|---|
| | 基金合同生效日（2015 年 7 月 14 日）持有的基金份额 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | - | 10,980,576.42 | - |
| 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 | - | - | 10,980,576.42 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | - | 11.21% | - |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 49,634,909.45 | 159,857.08 | 16,334,711.69 | 57,607.10 |

注：本基金通过“中国工商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 917,288.84 元。（2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 914,876.66 元）

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

| 6.4.8.1.1 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 4 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 | 新股流通受限 | 8.11 | 8.11 | 942 | 7,639.62 | 7,639.62 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----------|--------|------|------|-----|----------|----------|---|
| | | 日 | 5日 | | | | | | | |
| 603617 | 君禾股份 | 2017年6月23日 | 2017年7月4日 | 新股流通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

6.4.8.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600657 | 信达地产 | 2017年6月19日 | 重大资产重组 | 5.76 | 2017年8月10日 | 6.19 | 650,613 | 3,789,884.66 | 3,747,530.88 | - |
| 300486 | 东杰智能 | 2017年1月25日 | 重大资产重组 | 22.63 | 2017年8月9日 | 20.38 | 143,015 | 3,755,834.40 | 3,236,429.45 | - |
| 000862 | 银星能源 | 2017年3月13日 | 重大资产重组 | 7.90 | - | - | 406,600 | 3,311,401.00 | 3,212,140.00 | - |
| 601313 | 江南嘉捷 | 2017年6月12日 | 重大资产重组 | 8.79 | - | - | 112,116 | 1,238,637.64 | 985,499.64 | - |
| 002856 | 美芝股份 | 2017年6月19日 | 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 | 重大资产重组 | 20.15 | - | - | 1,657 | 11,632.14 | 33,388.55 | - |
| 300582 | 英飞特 | 2017年6月5日 | 重大资产重组 | 18.92 | 2017年8月2日 | 17.50 | 88 | 876.15 | 1,664.96 | - |
| 002567 | 唐人神 | 2017年6月7日 | 重大资产重组 | 9.70 | 2017年8月14日 | 9.54 | 81 | 725.79 | 785.70 | - |
| 300092 | 科新机电 | 2017年4月14日 | 重大资产重组 | 12.70 | - | - | 57 | 801.59 | 723.90 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-----|-----------|--------|------|---|---|----|--------|--------|---|
| 002076 | 雪莱特 | 2017年6月2日 | 重大资产重组 | 7.07 | - | - | 54 | 413.89 | 381.78 | - |
|--------|-----|-----------|--------|------|---|---|----|--------|--------|---|

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

§ 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 | 269,659,222.86 | 83.99 |
| | 其中：股票 | 269,659,222.86 | 83.99 |
| 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 | 50,552,198.29 | 15.74 |
| 7 | 其他各项资产 | 859,387.06 | 0.27 |
| 8 | 合计 | 321,070,808.21 | 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 | 144,594.75 | 0.05 |
| B | 采矿业 | 3,972,384.00 | 1.24 |
| C | 制造业 | 172,983,175.68 | 54.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,282,560.09 | 2.59 |
| E | 建筑业 | 8,106,875.30 | 2.54 |
| F | 批发和零售业 | 11,333,762.82 | 3.55 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,171,330.64 | 2.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,429,675.26 | 1.39 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,508,485.83 | 3.92 |
| J | 金融业 | 1,122,283.49 | 0.35 |
| K | 房地产业 | 20,786,010.88 | 6.51 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,332,687.32 | 1.04 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,652,748.00 | 1.46 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,394,008.00 | 0.44 |
| 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 | 2,696,467.00 | 0.84 |
| S | 综合 | 4,742,173.80 | 1.48 |
| | 合计 | 269,659,222.86 | 84.44 |

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前十名股票投资明细

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 | 000960 | 锡业股份 | 415,500 | 5,654,955.00 | 1.77 |
| 2 | 600502 | 安徽水利 | 733,200 | 5,638,308.00 | 1.77 |
| 3 | 002215 | 诺普信 | 648,700 | 5,488,002.00 | 1.72 |
| 4 | 600183 | 生益科技 | 437,981 | 5,404,685.54 | 1.69 |
| 5 | 002182 | 云海金属 | 586,000 | 5,385,340.00 | 1.69 |
| 6 | 000404 | 华意压缩 | 679,825 | 5,350,222.75 | 1.68 |
| 7 | 002354 | 天神娱乐 | 248,163 | 5,335,504.50 | 1.67 |
| 8 | 002329 | 皇氏集团 | 552,800 | 5,312,408.00 | 1.66 |
| 9 | 600761 | 安徽合力 | 396,800 | 5,198,080.00 | 1.63 |
| 10 | 002636 | 金安国纪 | 299,700 | 5,175,819.00 | 1.62 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

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 | 300250 | 初灵信息 | 7,803,787.00 | 3.73 |
| 2 | 300292 | 吴通控股 | 7,431,120.00 | 3.55 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3 | 000036 | 华联控股 | 7,341,792.28 | 3.51 |
| 4 | 002354 | 天神娱乐 | 6,151,443.00 | 2.94 |
| 5 | 300351 | 永贵电器 | 5,988,977.49 | 2.86 |
| 6 | 600507 | 方大特钢 | 5,778,626.00 | 2.76 |
| 7 | 600983 | 惠而浦 | 5,724,564.32 | 2.73 |
| 8 | 600997 | 开滦股份 | 5,630,616.00 | 2.69 |
| 9 | 601007 | 金陵饭店 | 5,624,645.68 | 2.69 |
| 10 | 300242 | 明家联合 | 5,521,673.96 | 2.64 |
| 11 | 300295 | 三六五网 | 5,499,521.20 | 2.63 |
| 12 | 002682 | 龙洲股份 | 5,487,803.49 | 2.62 |
| 13 | 300234 | 开尔新材 | 5,441,756.00 | 2.60 |
| 14 | 002329 | 皇氏集团 | 5,430,151.00 | 2.59 |
| 15 | 600502 | 安徽水利 | 5,349,032.00 | 2.55 |
| 16 | 002165 | 红宝丽 | 5,309,759.00 | 2.54 |
| 17 | 300371 | 汇中股份 | 5,293,852.48 | 2.53 |
| 18 | 000404 | 华意压缩 | 5,270,728.17 | 2.52 |
| 19 | 603167 | 渤海轮渡 | 5,217,064.48 | 2.49 |
| 20 | 300160 | 秀强股份 | 5,199,471.00 | 2.48 |

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 | 600507 | 方大特钢 | 8,211,988.00 | 3.92 |
| 2 | 300292 | 吴通控股 | 7,270,817.00 | 3.47 |
| 3 | 300106 | 西部牧业 | 7,001,241.70 | 3.34 |
| 4 | 002682 | 龙洲股份 | 6,089,439.30 | 2.91 |
| 5 | 002307 | 北新路桥 | 5,794,712.00 | 2.77 |
| 6 | 600983 | 惠而浦 | 5,597,049.67 | 2.67 |
| 7 | 300371 | 汇中股份 | 5,243,983.04 | 2.50 |
| 8 | 600533 | 栖霞建设 | 5,208,979.00 | 2.49 |
| 9 | 300241 | 瑞丰光电 | 4,994,993.23 | 2.39 |
| 10 | 002026 | 山东威达 | 4,651,084.00 | 2.22 |
| 11 | 300151 | 昌红科技 | 4,597,178.41 | 2.20 |
| 12 | 002504 | *ST 弘 | 4,383,238.50 | 2.09 |
| 13 | 002483 | 润邦股份 | 4,354,569.56 | 2.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 002110 | 三钢闽光 | 4,347,503.99 | 2.08 |
| 15 | 300242 | 明家联合 | 4,325,365.64 | 2.07 |
| 16 | 300121 | 阳谷华泰 | 4,296,689.00 | 2.05 |
| 17 | 600883 | 博闻科技 | 4,261,283.52 | 2.03 |
| 18 | 300047 | 天源迪科 | 4,242,256.80 | 2.03 |
| 19 | 600131 | 岷江水电 | 4,221,975.40 | 2.02 |
| 20 | 603663 | 三祥新材 | 4,201,611.98 | 2.01 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 557,033,906.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 447,507,164.97 |

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前十名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 | 84,421.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 301,114.81 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,822.25 |
| 5 | 应收申购款 | 464,028.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 859,387.06 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 9,527 | 27,671.32 | 70,977,096.20 | 26.92% | 192,647,574.67 | 73.08% |

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 | 1,096,167.45 | 0.42% |

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 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 50~100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015年7月14日）基金份额总额 | 648,523,672.21 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 164,987,040.12 |
| 本报告期基金总申购份额 | 244,276,707.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 145,639,076.38 |
| 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 | 263,624,670.87 |

§ 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 | |
| 国信证券 | 3 | 523,514,898.39 | 52.30% | 357,385.94 | 58.48% | - |
| 安信证券 | 2 | 477,505,311.28 | 47.70% | 253,700.84 | 41.52% | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |

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的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | 30,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

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

(2) 选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

§ 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。

长信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 24 日