

# 长信量化先锋混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 29 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 2018 年 8 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注 .....	21
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	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 .....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化先锋混合型证券投资基金	
基金简称	长信量化先锋混合	
基金主代码	519983	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 18 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,055,722,458.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
下属分级基金场内简称:	长信 LHA	-
下属分级基金的交易代码:	519983	004221
报告期末下属分级基金的份额总额	2,054,451,464.16 份	1,270,993.91 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95559
传真	021-61009800	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	成善栋	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、上海市仙霞路 18 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
A 类注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
C 类注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-237,082,300.41	-896,907.67
本期利润	-424,717,518.22	-1,417,495.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1600	-0.2468
本期加权平均净值利润率	-10.63%	-17.69%
本期基金份额净值增长率	-11.73%	-12.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-149,597,100.30	320,755.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0728	0.2524
期末基金资产净值	2,766,968,757.61	1,591,748.93
期末基金份额净值	1.347	1.252
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	107.52%	-25.94%

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

长信量化先锋混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.87%	1.70%	-5.63%	0.96%	0.76%	0.74%
过去三个月	-10.50%	1.34%	-7.03%	0.85%	-3.47%	0.49%
过去六个月	-11.73%	1.37%	-8.80%	0.87%	-2.93%	0.50%
过去一年	-13.15%	1.11%	-1.99%	0.71%	-11.16%	0.40%

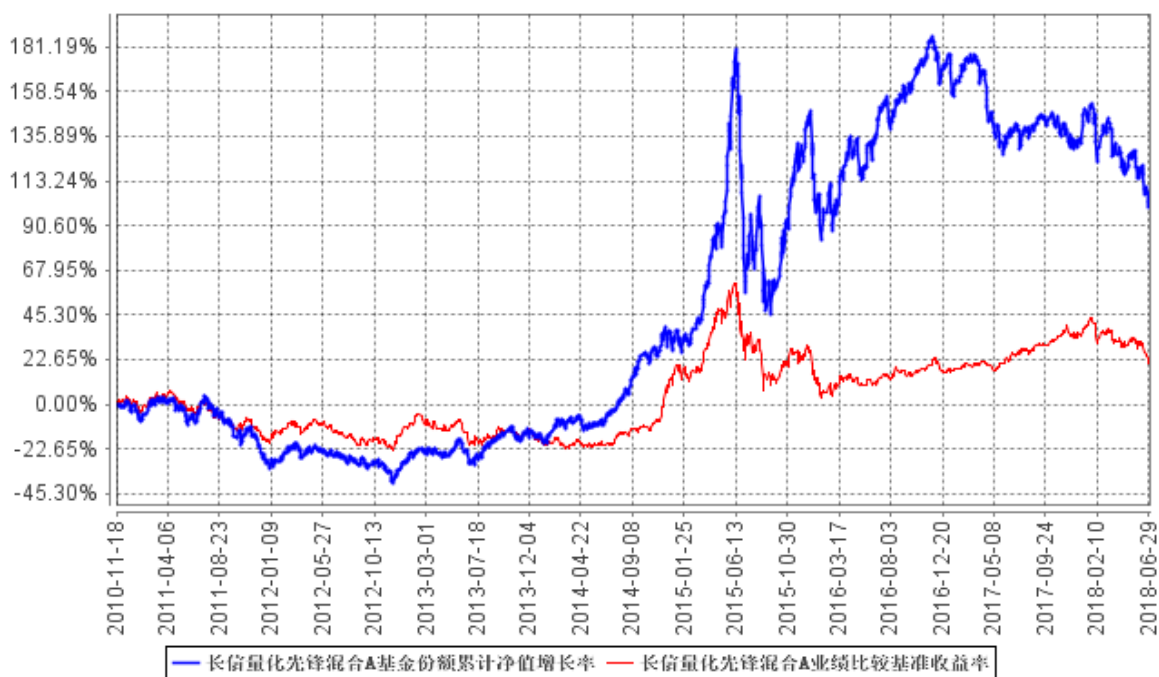


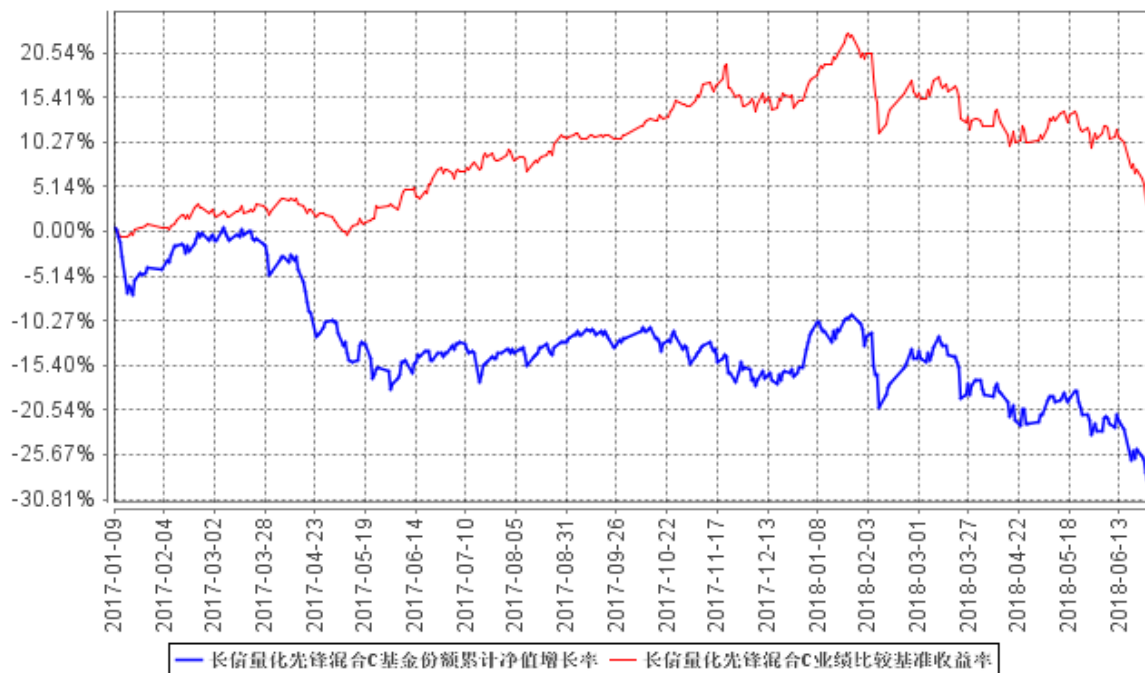
过去三年	-6.14%	1.77%	-12.94%	1.12%	6.80%	0.65%
自基金合同生效起至今	107.52%	1.53%	23.35%	1.09%	84.17%	0.44%

长信量化先锋混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.01%	1.70%	-5.63%	0.96%	0.62%	0.74%
过去三个月	-10.76%	1.34%	-7.03%	0.85%	-3.73%	0.49%
过去六个月	-12.14%	1.38%	-8.80%	0.87%	-3.34%	0.51%
过去一年	-14.01%	1.11%	-1.99%	0.71%	-12.02%	0.40%
自份额增加日起至今	-25.94%	1.08%	5.01%	0.64%	-30.95%	0.44%

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





注：1、长信量化先锋混合 A 图示日期为 2010 年 11 月 18 日至 2018 年 6 月 30 日，长信量化先锋混合 C 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2018 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金管理人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）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 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、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金 (LOF)、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金 (LOF)、长信低	2015 年 3 月 14 日	-	8 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。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理。现任量化投资部总监、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、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、

	碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监				长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--	--

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

回顾 2018 年上半年，市场先涨后跌，风格切换频繁。各主要指数均遭受较大幅下调，调整幅度平均在 15% 左右，指数估值水平回归至历史低位，个股涨跌幅中位数在 -20% 左右。大小盘分化方面，年初分化较为明显，大盘蓝筹和中小盘成长股均迎来各自一轮单边上涨行情，进入二季度后期，大小盘均经历较大调整，此中分化不甚明显。主题方面，消费板块一枝独秀，成长股板块先涨后跌，其他主题较为乏善可陈。事件方面，诸如独角兽回归、两会召开、贸易战摩擦不断升级、央行去杠杆防风险的持续推进、金融监管不断加强等种种利空因素叠加，加之刚兑打破债务违约常态化以及部分优质股业绩接连爆雷致使市场情绪面较为波动，整体走势较为震荡。最终，市场各主要指数在二季度均跌幅收官，上证综指收跌 13.30%，沪深 300 收跌 12.90%，中证 500 收跌 16.53%，中小板指收跌 14.26%，创业板指收跌 8.33%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，量化先锋 A 份额净值为 1.347 元，份额累计净值为 2.197 元，本报告期内量化先锋 A 份额净值增长率为 -11.73%；量化先锋 C 份额净值为 1.252 元，份额累计净值为 1.552 元，本报告期内量化先锋 C 份额净值增长率为 -12.14%。同期业绩比较基准收益率为 -8.80%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来我们认为，宏观层面，当前中美贸易摩擦增多，房地产融资成本上升、基建投资增速放缓、内需显著回落等因素使得经济增速承压，但我们认为不应对宏观经济过度悲观。一方面中国经济经过各项改革举措会体现出足够的韧性，且“以量换质”的增长方式在日后会释放更多改革红利，另一方面，在更为高频的煤电耗量等数据中我们发现宏观经济有望起底回升。市场方面，宏观不确定性因素较多，加之去杠杆、防风险的持续推进，融资成本的上升以及金融监管加强等原因使得当前市场仍处于存量博弈中，市场情绪较为羸弱，交易量低迷，在这种状态下单边上涨行情大概率不会出现。但，市场主要指数估值均调整至历史低位水平，上证综指逼近熔断底部，当前有望成为阶段性低点，加之中报业绩催化，未来结构性反弹行情可期。

我们将致力于寻找具有股价安全边际的优质成长股，将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有

效投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员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，均具备估值业务所需的专业胜任能力，基金经理不直接参与估值决策。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 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相应类别的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、同一类别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各类基金份额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

2018 年上半年度，基金托管人在长信量化先锋混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行利润分配。

### 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

2018 年上半年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化先锋混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	61,539,087.80	89,957,049.18
结算备付金		25,579,199.87	16,338,188.48
存出保证金		814,666.82	1,169,964.30
交易性金融资产	6.4.6.2	2,690,886,736.52	4,631,027,837.84
其中：股票投资		2,449,287,908.52	4,383,007,647.86
基金投资		-	-
债券投资		241,598,828.00	248,020,189.98
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		-	270,291,381.34
应收利息	6.4.6.5	6,423,450.24	1,465,146.54
应收股利		-	-
应收申购款		3,258,891.13	3,447,404.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		2,788,502,032.38	5,013,696,972.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		3,393,739.06	242,520,825.21
应付赎回款		7,418,117.49	72,318,114.31
应付管理人报酬		3,687,593.22	6,238,983.41
应付托管费		614,598.86	1,039,830.58
应付销售服务费		1,338.04	1,457.60
应付交易费用	6.4.6.7	4,562,865.11	5,570,278.85

应交税费		2.69	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	263,271.37	753,305.11
负债合计		19,941,525.84	328,442,795.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	2,055,722,458.07	3,069,672,311.86
未分配利润	6.4.6.10	712,838,048.47	1,615,581,865.50
所有者权益合计		2,768,560,506.54	4,685,254,177.36
负债和所有者权益总计		2,788,502,032.38	5,013,696,972.43

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长信量化先锋 A 基金份额净值 1.347 元，长信量化先锋 C 基金份额净值 1.252 元。基金份额总额 2,055,722,458.07 份，其中长信量化先锋 A 份额 2,054,451,464.16 份，长信量化先锋 C 份额 1,270,993.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-375,358,878.14	-946,683,762.03
1.利息收入		5,653,892.96	12,422,042.80
其中：存款利息收入	6.4.6.11	611,088.55	12,242,245.35
债券利息收入		4,888,864.76	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		153,939.65	179,797.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-194,631,733.62	-173,572,037.75
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-228,960,124.41	-198,853,908.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	979,062.81	-
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	33,349,327.98	25,281,870.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-188,155,805.31	-792,945,804.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	1,774,767.83	7,412,037.12
<b>减：二、费用</b>		50,776,135.25	98,626,352.01
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	29,805,469.00	67,746,502.50
2. 托管费	6.4.9.2.2	4,967,578.17	11,291,083.74
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	40,579.38	6,586.39
4. 交易费用	6.4.6.19	15,795,330.61	19,366,236.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.64	-
7. 其他费用	6.4.6.20	167,175.45	215,943.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-426,135,013.39	-1,045,310,114.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-426,135,013.39	-1,045,310,114.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,069,672,311.86	1,615,581,865.50	4,685,254,177.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-426,135,013.39	-426,135,013.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,013,949,853.79	-476,608,803.64	-1,490,558,657.43
其中：1.基金申购款	469,800,182.25	245,132,693.67	714,932,875.92
2.基金赎回款	-1,483,750,036.04	-721,741,497.31	-2,205,491,533.35
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)	2,055,722,458.07	712,838,048.47	2,768,560,506.54
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,557,393,335.62	5,386,681,925.25	10,944,075,260.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,045,310,114.04	-1,045,310,114.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,079,162,661.10	-895,812,799.41	-1,974,975,460.51
其中：1.基金申购款	2,557,135,304.29	2,174,840,287.75	4,731,975,592.04
2.基金赎回款	-3,636,297,965.39	-3,070,653,087.16	-6,706,951,052.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-976,844,514.90	-976,844,514.90
五、期末所有者权益(基金净值)	4,478,230,674.52	2,468,714,496.90	6,946,945,171.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 成善栋 _____	_____ 覃波 _____	_____ 孙红辉 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信量化先锋混合型证券投资基金(原名长信量化先锋股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,

经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2010]962号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为324,671,697.42份,经上海众华沪银会计师事务所有限公司验证,并出具了沪众会字(2010)第4128号验资报告。基金合同于2010年11月18日生效。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2017年1月4日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋混合型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》,从2017年1月9日起,本基金增设C类份额(以下简称“长信量化先锋混合C”),长信量化先锋混合C的年销售服务费率为1.00%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额(以下简称“长信量化先锋混合A”),长信量化先锋混合A不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信量化先锋混合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。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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 75%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至

2018 年 6 月 30 日止期间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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;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,股息红利所得暂免征收个人所得税。

上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	61,539,087.80
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	61,539,087.80

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,558,501,182.97	2,449,287,908.52	-109,213,274.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	758,828.00	97,828.00
	银行间市场	241,000,080.00	-160,080.00
	合计	241,661,080.00	-62,252.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,800,162,262.97	2,690,886,736.52	-109,275,526.45

### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	6,725.45
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	7,119.54
应收债券利息	6,409,274.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.38
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	329.94
合计	6,423,450.24

注：其他为应收结算保证金利息。

**6.4.6.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.6.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,562,277.08
银行间市场应付交易费用	588.03
合计	4,562,865.11

**6.4.6.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	15,420.84
预提信息披露费-证券时报	149,588.57
预提账户维护费	9,000.00
预提信息披露费-证券日报	44,630.98
预提审计费	44,630.98
合计	263,271.37

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信量化先锋混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,068,453,657.67	3,068,453,657.67
本期申购	450,601,997.59	450,601,997.59
本期赎回(以“-”号填列)	-1,464,604,191.10	-1,464,604,191.10
- 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	2,054,451,464.16	2,054,451,464.16

金额单位：人民币元

长信量化先锋混合 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,218,654.19	1,218,654.19
本期申购	19,198,184.66	19,198,184.66
本期赎回(以“-”号填列)	-19,145,844.94	-19,145,844.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,270,993.91	1,270,993.91

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

长信量化先锋混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,168,041.89	1,521,895,714.68	1,615,063,756.57

本期利润	-237,082,300.41	-187,635,217.81	-424,717,518.22
本期基金份额交易产生的变动数	-5,682,841.78	-472,146,103.12	-477,828,944.90
其中：基金申购款	12,191,588.17	224,870,948.90	237,062,537.07
基金赎回款	-17,874,429.95	-697,017,052.02	-714,891,481.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-149,597,100.30	862,114,393.75	712,517,293.45

单位：人民币元

长信量化先锋混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	453,761.85	64,347.08	518,108.93
本期利润	-896,907.67	-520,587.50	-1,417,495.17
本期基金份额交易产生的变动数	786,986.46	433,154.80	1,220,141.26
其中：基金申购款	7,394,257.70	675,898.90	8,070,156.60
基金赎回款	-6,607,271.24	-242,744.10	-6,850,015.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	343,840.64	-23,085.62	320,755.02

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	519,715.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,686.23
结算备付金利息收入	75,319.37
其他	7,367.51
合计	611,088.55

注：其他为保证金利息收入。

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	6,707,194,834.71
减：卖出股票成本总额	6,936,154,959.12
买卖股票差价收入	-228,960,124.41

### 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 2018年1月1日至2018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	979,062.81
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	979,062.81

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,693,531.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,712,100.00
减：应收利息总额	2,368.39
买卖债券差价收入	979,062.81

#### 6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.6.14 贵金属投资收益

#### 6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.6.15 衍生工具收益

#### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.6.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	33,349,327.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,349,327.98

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-188,155,805.31
——股票投资	-187,785,543.33
——债券投资	-370,261.98
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-188,155,805.31

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,650,206.58
转换费收入 519983	124,561.25
转换费收入	-
合计	1,774,767.83

注：针对 A 类基金份额：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余不低于所收取的赎回费总额的 25% 归基金财产；针对 C 类基金份额：对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，不计入基金财产。

**6.4.6.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	15,795,330.61
合计	15,795,330.61

**6.4.6.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	94,219.55
帐户维护费	22,500.00
其他费用	5,824.92
合计	167,175.45

注：其他费用为银行手续费和上清中债查询费。

**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：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**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**

注：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、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,604,481,869.33	13.50%	2,465,226,072.90	17.31%

#### 6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	1,419,429.34	17.67%	854,336.93	18.73%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长江证券	2,101,783.59	21.67%	53,220.03	1.66%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,805,469.00	67,746,502.50
其中：支付销售机构的客户维护费	11,060,272.90	19,008,263.02

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,967,578.17	11,291,083.74

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	6,385.81	6,385.81
合计	-	6,385.81	6,385.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		



	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	3,499.45	3,499.45
合计	-	3,499.45	3,499.45

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费率按年费率 1.00%。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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持有本基金。

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	61,539,087.80	519,715.44	499,161,306.28	455,464.86

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于 2018 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2017 年 12 月 31 日：同）

#### 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。本基金非基金中基金，不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2018 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
601138	工业富联	2018年6月8日	2019年6月7日	新股锁定	13.77	16.40	17,576	242,021.52	288,246.40	-

##### 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
000415	渤海金控	2018年1月17日	拟筹划重大资	5.84	2018年7月17日	5.26	3,300,079	22,786,238.06	19,272,461.36	-

			产重组							
300118	东方日升	2018年5月7日	拟筹划重大资产重组	10.80	2018年8月7日	9.63	490,720	6,602,373.60	5,299,776.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	拟筹划重大资产重组	13.08	2018年8月27日	13.47	125,800	2,467,616.65	1,645,464.00	-

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。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理念，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。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。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级资产支持证券。

##### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级同业存单。

##### 6.4.12.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	758,828.00	7,348,189.98
未评级	240,840,000.00	240,672,000.00
合计	241,598,828.00	248,020,189.98

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级资产支持证券。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级同业存单。

### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### 6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	61,539,087.80	-	-	-	-	61,539,087.80
结算备付金	25,579,199.87	-	-	-	-	25,579,199.87
存出保证金	814,666.82	-	-	-	-	814,666.82
交易性金融资产	240,840,000.00	758,828.00	-	-	-2,449,287,908.52	2,690,886,736.52
应收利息	-	-	-	-	6,423,450.24	6,423,450.24
应收申购款	4,470.22	-	-	-	3,254,420.91	3,258,891.13
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	328,777,424.71	758,828.00	-	-	-2,458,965,779.67	2,788,502,032.38
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	3,393,739.06	3,393,739.06
应付赎回款	-	-	-	-	7,418,117.49	7,418,117.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,687,593.22	3,687,593.22
应付托管费	-	-	-	-	614,598.86	614,598.86
应付销售服务费	-	-	-	-	1,338.04	1,338.04
应付交易费用	-	-	-	-	4,562,865.11	4,562,865.11
应交税费	-	-	-	-	2.69	2.69
其他负债	-	-	-	-	263,271.37	263,271.37
负债总计	-	-	-	-	19,941,525.84	19,941,525.84
利率敏感度缺口	328,777,424.71	758,828.00	-	-	-2,439,024,253.83	2,768,560,506.54
上年度末 2017 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	89,957,049.18	-	-	-	-	89,957,049.18
结算备付金	16,338,188.48	-	-	-	-	16,338,188.48
存出保证金	1,169,964.30	-	-	-	-	1,169,964.30
交易性金融资产	5,955,548.60	242,064,641.38	-	-	-4,383,007,647.86	4,631,027,837.84
应收证券清算款	-	-	-	-	270,291,381.34	270,291,381.34
应收利息	-	-	-	-	1,465,146.54	1,465,146.54
应收申购款	-	-	-	-	3,447,404.75	3,447,404.75
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	113,420,750.56	242,064,641.38	-	-	4,658,211,580.49	5,013,696,972.43
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	242,520,825.21	242,520,825.21
应付赎回款	-	-	-	-	72,318,114.31	72,318,114.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	6,238,983.41	6,238,983.41
应付托管费	-	-	-	-	1,039,830.58	1,039,830.58
应付销售服务费	-	-	-	-	1,457.60	1,457.60
应付交易费用	-	-	-	-	5,570,278.85	5,570,278.85
其他负债	-	-	-	-	753,305.11	753,305.11
负债总计	-	-	-	-	328,442,795.07	328,442,795.07
利率敏感度缺口	113,420,750.56	242,064,641.38	-	-	4,329,768,785.42	4,685,254,177.36

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	242,317.10	651,527.20
	市场利率上升 27 个基点	-242,317.10	-651,527.20

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

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

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

## 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,449,287,908.52	88.47	4,383,007,647.86	93.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	241,598,828.00	8.73	248,020,189.98	5.29
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,690,886,736.52	97.19	4,631,027,837.84	98.84

## 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.77%（2017 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.00%）	-104,265,933.10	-140,726,663.12

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金融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。2017 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

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民



币 2,423,452,758.61 元，属于第二层次的余额为人民币 267,433,977.91 元，属于第三层次的余额为人民币 0 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的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应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,449,287,908.52	87.84
	其中：股票	2,449,287,908.52	87.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	241,598,828.00	8.66
	其中：债券	241,598,828.00	8.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	87,118,287.67	3.12
8	其他各项资产	10,497,008.19	0.38
9	合计	2,788,502,032.38	100.00

注：本基金本报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,649,093,227.96	59.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,256,085.85	2.97
E	建筑业	1,645,464.00	0.06
F	批发和零售业	94,713,177.44	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	27,162,144.75	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	206,151,452.74	7.45
J	金融业	168,936,895.10	6.10
K	房地产业	63,291,818.14	2.29

L	租赁和商务服务业	54,375,911.36	1.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	34,487,791.53	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,162,676.13	0.62
R	文化、体育和娱乐业	50,011,263.52	1.81
S	综合	-	-
	合计	2,449,287,908.52	88.47

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	849,443	40,051,237.45	1.45
2	600585	海螺水泥	1,123,700	37,621,476.00	1.36
3	002078	太阳纸业	3,811,300	36,931,497.00	1.33
4	002008	大族激光	690,000	36,701,100.00	1.33
5	600801	华新水泥	2,391,949	35,950,993.47	1.30
6	601888	中国国旅	545,000	35,103,450.00	1.27
7	600845	宝信软件	1,331,334	35,080,650.90	1.27
8	600309	万华化学	767,326	34,851,946.92	1.26
9	600566	济川药业	722,549	34,819,636.31	1.26
10	600031	三一重工	3,871,700	34,729,149.00	1.25
11	600567	山鹰纸业	8,980,029	34,662,911.94	1.25
12	000338	潍柴动力	3,927,037	34,361,573.75	1.24
13	000830	鲁西化工	2,004,666	34,239,695.28	1.24
14	000333	美的集团	650,037	33,944,932.14	1.23
15	000418	小天鹅A	480,064	33,292,438.40	1.20
16	601318	中国平安	564,831	33,087,799.98	1.20
17	300188	美亚柏科	1,760,080	32,209,464.00	1.16
18	300271	华宇软件	1,791,559	31,674,763.12	1.14
19	600426	华鲁恒升	1,800,000	31,662,000.00	1.14
20	601877	正泰电器	1,409,975	31,470,642.00	1.14
21	600741	华域汽车	1,325,591	31,443,018.52	1.14

22	300170	汉得信息	1,925,776	31,274,602.24	1.13
23	000528	柳工	2,889,534	30,946,909.14	1.12
24	600486	扬农化工	550,691	30,800,147.63	1.11
25	002376	新北洋	1,860,000	30,764,400.00	1.11
26	300296	利亚德	2,366,271	30,477,570.48	1.10
27	601100	恒立液压	1,449,937	30,274,684.56	1.09
28	300122	智飞生物	660,160	30,195,718.40	1.09
29	601601	中国太保	947,200	30,168,320.00	1.09
30	600282	南钢股份	6,710,000	29,658,200.00	1.07
31	000786	北新建材	1,600,061	29,649,130.33	1.07
32	000425	徐工机械	6,974,200	29,570,608.00	1.07
33	601155	新城控股	939,778	29,104,924.66	1.05
34	600782	新钢股份	5,080,400	28,348,632.00	1.02
35	000703	恒逸石化	1,894,773	28,194,222.24	1.02
36	300003	乐普医疗	768,600	28,192,248.00	1.02
37	300121	阳谷华泰	1,996,547	28,011,554.41	1.01
38	600323	瀚蓝环境	1,834,340	27,918,654.80	1.01
39	600703	三安光电	1,450,000	27,869,000.00	1.01
40	600681	百川能源	2,107,045	27,307,303.20	0.99
41	002460	赣锋锂业	707,400	27,291,492.00	0.99
42	600029	南方航空	3,214,455	27,162,144.75	0.98
43	300144	宋城演艺	1,154,340	27,126,990.00	0.98
44	300335	迪森股份	2,533,700	26,958,568.00	0.97
45	600104	上汽集团	758,725	26,547,787.75	0.96
46	600859	王府井	1,242,634	26,430,825.18	0.95
47	000568	泸州老窖	434,036	26,415,430.96	0.95
48	600346	恒力股份	1,787,176	26,200,000.16	0.95
49	600487	亨通光电	1,185,845	26,147,882.25	0.94
50	603799	华友钴业	265,771	25,904,699.37	0.94
51	001979	招商蛇口	1,348,782	25,694,297.10	0.93
52	000789	万年青	2,286,200	25,011,028.00	0.90
53	300422	博世科	1,724,616	24,575,778.00	0.89
54	002439	启明星辰	1,150,027	24,403,572.94	0.88
55	000963	华东医药	500,656	24,156,652.00	0.87
56	300450	先导智能	798,476	24,145,914.24	0.87
57	300316	晶盛机电	1,764,930	23,455,919.70	0.85
58	600596	新安股份	1,420,722	22,973,074.74	0.83
59	600867	通化东宝	956,419	22,925,363.43	0.83
60	002640	跨境通	1,525,548	22,913,730.96	0.83

61	600705	中航资本	4,906,276	22,912,308.92	0.83
62	300251	光线传媒	2,247,964	22,884,273.52	0.83
63	601628	中国人寿	1,013,328	22,820,146.56	0.82
64	601688	华泰证券	1,521,500	22,776,855.00	0.82
65	002449	国星光电	2,107,335	22,422,044.40	0.81
66	000636	风华高科	1,365,005	21,676,279.40	0.78
67	600176	中国巨石	2,118,289	21,670,096.47	0.78
68	002597	金禾实业	1,033,300	20,955,324.00	0.76
69	600690	青岛海尔	1,064,500	20,502,270.00	0.74
70	600036	招商银行	769,000	20,332,360.00	0.73
71	000661	长春高新	89,206	20,312,206.20	0.73
72	601636	旗滨集团	4,436,345	19,741,735.25	0.71
73	000415	渤海金控	3,300,079	19,272,461.36	0.70
74	601012	隆基股份	1,138,658	19,004,202.02	0.69
75	600160	巨化股份	2,521,631	18,458,338.92	0.67
76	002422	科伦药业	570,400	18,309,840.00	0.66
77	300308	中际旭创	303,401	18,216,196.04	0.66
78	300347	泰格医药	277,399	17,162,676.13	0.62
79	300212	易华录	714,609	16,900,502.85	0.61
80	601336	新华保险	392,703	16,839,104.64	0.61
81	002294	信立泰	431,204	16,027,852.68	0.58
82	002334	英威腾	2,473,721	14,471,267.85	0.52
83	600809	山西汾酒	229,203	14,414,576.67	0.52
84	002304	洋河股份	104,100	13,699,560.00	0.49
85	600588	用友网络	542,990	13,308,684.90	0.48
86	600352	浙江龙盛	990,213	11,833,045.35	0.43
87	002002	鸿达兴业	2,534,508	11,684,081.88	0.42
88	603808	歌力思	501,259	11,283,340.09	0.41
89	000717	韶钢松山	1,719,842	11,282,163.52	0.41
90	000513	丽珠集团	255,450	11,227,027.50	0.41
91	002466	天齐锂业	214,015	10,613,003.85	0.38
92	002717	岭南股份	1,002,119	9,830,787.39	0.36
93	000858	五粮液	123,900	9,416,400.00	0.34
94	300383	光环新网	680,800	9,129,528.00	0.33
95	300274	阳光电源	1,017,609	9,127,952.73	0.33
96	600729	重庆百货	268,029	8,831,555.55	0.32
97	002146	荣盛发展	972,806	8,492,596.38	0.31
98	002727	一心堂	229,775	7,456,198.75	0.27
99	300523	辰安科技	114,454	7,128,195.12	0.26

100	600056	中国医药	332,962	6,083,215.74	0.22
101	603111	康尼机电	857,903	5,670,738.83	0.20
102	300207	欣旺达	626,400	5,643,864.00	0.20
103	002019	亿帆医药	316,578	5,587,601.70	0.20
104	300118	东方日升	490,720	5,299,776.00	0.19
105	300036	超图软件	247,253	5,041,488.67	0.18
106	002419	天虹股份	337,275	4,924,215.00	0.18
107	600398	海澜之家	225,229	2,869,417.46	0.10
108	600507	方大特钢	223,700	2,391,353.00	0.09
109	002310	东方园林	125,800	1,645,464.00	0.06
110	600535	天士力	51,221	1,322,526.22	0.05
111	601003	柳钢股份	73,300	580,536.00	0.02
112	601138	工业富联	17,576	288,246.40	0.01
113	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
114	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.00
115	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
116	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
117	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
118	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
119	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
120	603788	宁波高发	65	1,601.60	0.00
121	300398	飞凯材料	61	1,193.16	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	600176	中国巨石	63,756,081.79	1.36
2	600029	南方航空	60,189,224.50	1.28
3	000528	柳工	50,287,699.89	1.07
4	601888	中国国旅	47,958,213.40	1.02
5	300144	宋城演艺	47,632,612.36	1.02
6	002146	荣盛发展	46,804,431.60	1.00
7	000963	华东医药	46,789,515.50	1.00
8	601155	新城控股	41,314,734.14	0.88
9	300145	中金环境	41,137,123.92	0.88

10	600867	通化东宝	39,170,555.64	0.84
11	600845	宝信软件	37,932,462.00	0.81
12	600114	东睦股份	37,738,752.93	0.81
13	300136	信维通信	37,705,767.96	0.80
14	300036	超图软件	36,767,482.47	0.78
15	600703	三安光电	36,758,320.80	0.78
16	002635	安洁科技	36,688,383.21	0.78
17	600104	上汽集团	36,480,579.27	0.78
18	600705	中航资本	36,350,229.56	0.78
19	600036	招商银行	36,279,205.39	0.77
20	002019	亿帆医药	36,066,337.84	0.77

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	000725	京东方 A	76,304,476.00	1.63
2	300182	捷成股份	61,547,014.91	1.31
3	601678	滨化股份	56,697,581.23	1.21
4	600516	方大炭素	56,642,010.28	1.21
5	600729	重庆百货	56,587,773.68	1.21
6	600966	博汇纸业	55,186,239.89	1.18
7	601006	大秦铁路	53,982,407.49	1.15
8	600761	安徽合力	53,919,333.04	1.15
9	600690	青岛海尔	53,533,042.76	1.14
10	000425	徐工机械	52,016,664.50	1.11
11	600271	航天信息	51,053,141.23	1.09
12	002195	二三四五	50,860,546.12	1.09
13	600398	海澜之家	50,846,837.11	1.09
14	600325	华发股份	50,697,602.60	1.08
15	600859	王府井	50,392,370.99	1.08
16	000525	红太阳	49,342,889.62	1.05
17	000830	鲁西化工	48,588,958.11	1.04
18	600426	华鲁恒升	47,923,106.95	1.02
19	600606	绿地控股	46,994,882.00	1.00
20	600183	生益科技	46,753,552.84	1.00

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	5,190,220,763.11
卖出股票收入（成交）总额	6,707,194,834.71

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	240,840,000.00	8.70
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）	758,828.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	241,598,828.00	8.73

### 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	130023	13 付息国债 23	2,400,000	240,840,000.00	8.70
2	128035	大族转债	6,610	758,828.00	0.03

### 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	814,666.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	6,423,450.24
5	应收申购款	3,258,891.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,497,008.19

#### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信量化先锋混合 A	356,117	5,769.04	84,660,317.64	4.12%	1,969,791,146.52	95.88%
长信量化先锋混合 C	68	18,691.09	0.00	0.00%	1,270,993.91	100.00%
合计	356,185	5,771.50	84,660,317.64	4.12%	1,971,062,140.43	95.88%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信量化先锋混合 A	52,805.15	0.00%
	长信量化先锋混合 C	0.00	0.00%
	合计	52,805.15	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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信量化先锋混合 A	0
	长信量化先锋混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信量化先锋混合 A	0
	长信量化先锋混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信量化先锋混合 A	长信量化先锋混合 C
基金合同生效日（2010 年 11 月 18 日）基金份额总额	324,671,697.42	-
本报告期期初基金份额总额	3,068,453,657.67	1,218,654.19
本报告期基金总申购份额	450,601,997.59	19,198,184.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,464,604,191.10	19,145,844.94
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	2,054,451,464.16	1,270,993.91

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

### 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	
爱建证券	1	2,073,322,746.86	17.44%	1,101,554.96	13.71%	-
金元证券	1	1,759,454,575.66	14.80%	934,802.67	11.64%	-
长江证券	2	1,604,481,869.33	13.50%	1,419,429.34	17.67%	-
方正证券	1	1,352,859,100.18	11.38%	718,771.43	8.95%	-

兴业证券	2	946,931,877.35	7.96%	787,183.46	9.80%	-
华泰证券	2	846,474,460.10	7.12%	449,733.63	5.60%	-
中银国际证 券	1	587,965,467.52	4.95%	488,779.54	6.08%	-
申银万国	1	525,534,928.48	4.42%	436,878.36	5.44%	-
广发证券	1	511,175,662.51	4.30%	424,940.76	5.29%	-
华创证券	1	457,910,235.46	3.85%	426,452.33	5.31%	-
光大证券	1	350,954,264.90	2.95%	291,746.75	3.63%	-
中泰证券	1	299,045,907.97	2.52%	248,598.07	3.09%	-
平安证券	1	295,732,836.60	2.49%	157,118.39	1.96%	-
海通证券	1	229,139,914.30	1.93%	121,742.71	1.52%	-
东北证券	1	48,141,475.97	0.40%	25,578.38	0.32%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
广发证券(已 退租)	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
爱建证券	353,348.90	4.59%	-	-	-	-
金元证券	1,471,474.90	19.13%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	5,868,707.40	76.28%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券(已 退租)	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用开源证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2017 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下	上证报、中证报、证	2018 年 1 月 4 日

	基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	券时报、公司网站	
3	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 5 日
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 16 日
5	长信量化先锋混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 1 月 20 日
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 1 日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海长量基金销售投资顾问有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 2 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 6 日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 7 日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 10 日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下 53 只基金修改基金合同、托管协议的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 24 日
12	长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同(流动性新规修改)	公司网站	2018 年 3 月 24 日
13	长信量化先锋混合型证券投资基金托管协议(流动性新规修改)	公司网站	2018 年 3 月 24 日
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购(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	2018 年 3 月 29 日
15	长信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 29 日



16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 30 日
17	长信量化先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告及摘要(仅摘要见报)	证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 3 月 31 日
18	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	2018 年 4 月 18 日
19	长信量化先锋混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 4 月 20 日
20	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	2018 年 4 月 21 日
21	长信基金管理有限责任公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 5 月 7 日
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 5 月 8 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国银河证券股份有限公司基金申购(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	2018 年 5 月 17 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 5 月 28 日
25	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 5 月 31 日
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 7 日
27	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 15 日
28	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 20 日
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 22 日

30	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 28 日
31	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加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）费率优惠活动及网上银行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	2018 年 6 月 30 日
32	长信量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书（2018 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	证券时报、证券日报、公司网站	2018 年 6 月 30 日
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 6 月 30 日资产净值的公告	公司网站	2018 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

注：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

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2018年8月29日