

长信量化中小盘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25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2月4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	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
§ 8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9	开放式基金份额变动	51

§ 10	重大事件揭示.....	52
10.1	基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4	基金投资策略的改变.....	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
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.....	54
§ 11	备查文件目录.....	57
11.1	备查文件目录.....	57
11.2	存放地点.....	57
11.3	查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信量化中小盘股票型证券投资基金
基金简称	长信量化中小盘股票
场内简称	CXLH中小
基金主代码	519975
交易代码	519975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月4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	199,123,115.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小盘股票，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700指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	周永刚	汤嵩彦
	联系电话	021-61009999	95559

人	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	上海证券报、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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年2月4日至2015年6月30日）
本期已实现收益	181,752,636.14
本期利润	183,554,586.14
加权平均基金份额本期利润	0.3271
本期加权平均净值利润率	28.96%
本期基金份额净值增长率	28.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015年6月30日）
期末可供分配利润	57,234,070.26
期末可供分配基金份额利润	0.2874
期末基金资产净值	256,357,185.50
期末基金份额净值	1.287
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015年6月30日）
基金份额累计净值增长率	28.70%

注：1、本基金基金合同生效日为2015年2月4日，截至本报告期末，本基金运作未满半年。

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

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

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

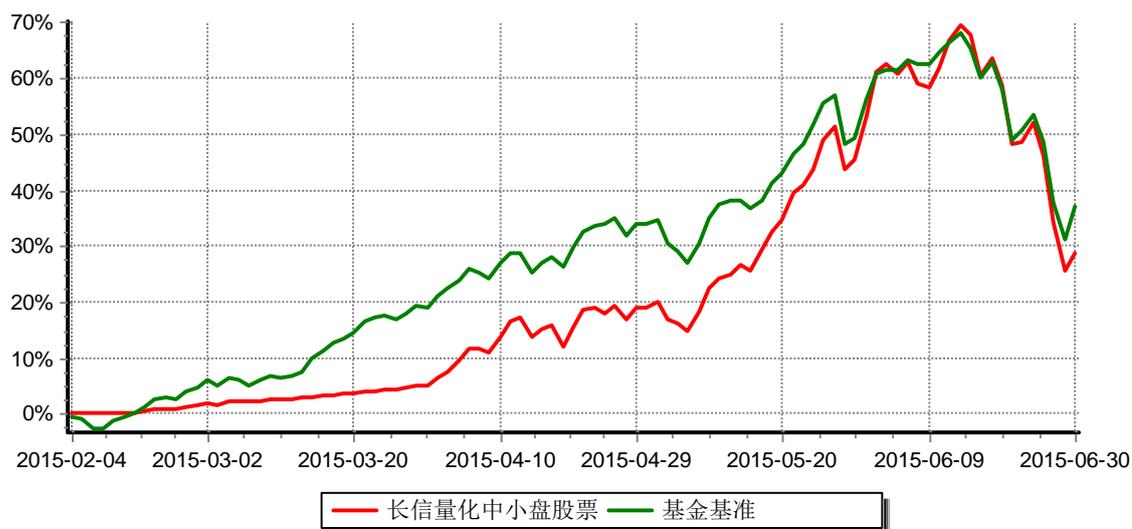
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

		差②		④		
过去一个月	-11.55%	3.77%	-7.39%	2.85%	-4.16%	0.92%
过去三个月	22.57%	2.77%	14.57%	2.16%	8.00%	0.61%
自基金合同生效日起 至今（2015年2月4日 -2015年6月30日）	28.70%	2.22%	37.09%	1.80%	-8.39%	0.42%

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、本基金基金合同生效日为2015年2月4日，图示日期为2015年2月4日至2015年6月30日，截至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

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将符合基金合同的约定：股票资产占基金资产的比例为80%–95%，投资于中小盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款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的比例范围是基金资产的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。截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

§ 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）、长信量化先锋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、长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）和长信量化先锋股票型证券投资基金的基金经理。
胡倩	金融工程	2015年2月4日	2015年3月	14年	曾任本基金的基金经理。

	部总监、 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 先锋股票 型证券投 资基金的 基金经理	日	14		
--	---	---	----	--	--

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1.287元，本报告期内本基金净值增长率为28.70%，同期业绩比较基准涨幅为37.09%。

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2015年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建设投资有望加码，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、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6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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

2015年上半年度,基金托管人在长信量化中小盘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中小盘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中小盘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：长信量化中小盘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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	61,563,293.57
结算备付金		2,349,183.79
存出保证金		536,023.53
交易性金融资产	6.4.7.2	191,712,619.80
其中：股票投资		191,712,619.80
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		24,677,252.62
应收利息	6.4.7.5	13,479.75
应收股利		—
应收申购款		1,002,787.58
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		281,854,640.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		23,237,100.10
应付管理人报酬		470,044.24

应付托管费		78,340.72
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	1,529,697.83
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	182,272.25
负债合计		25,497,455.14
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	199,123,115.24
未分配利润	6.4.7.10	57,234,070.26
所有者权益合计		256,357,185.50
负债和所有者权益总计		281,854,640.64

注：1、报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.287元，基金份额总额199,123,115.24份。

2、本基金本报告期为2015年2月4日至2015年6月30日，本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2015年2月4日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年2月4日（基金合同生效日） 至2015年6月30日
一、收入		191,721,090.18
1. 利息收入		1,788,254.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,458,952.33
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		329,302.18
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		184,941,471.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	183,790,081.60
基金投资收益		—

债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	1,151,390.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,801,950.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,189,413.95
减：二、费用		8,166,504.04
1. 管理人报酬		3,835,715.66
2. 托管费		639,286.01
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	3,543,708.84
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	147,793.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		183,554,586.14
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		183,554,586.14

注：本基金本报告期为2015年2月4日至2015年6月30日，本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2015年2月4日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）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）	869,346,402.40	—	869,346,402.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	183,554,586.14	183,554,586.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减）	-670,223,287.16	-126,320,515.88	-796,543,803.04

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	73,303,223.08	29,032,215.42	102,335,438.50
2. 基金赎回款	-743,526,510.24	-155,352,731.30	-898,879,241.54
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）	199,123,115.24	57,234,070.26	256,357,185.50

注：本基金本报告期为2015年2月4日至2015年6月30日，本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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

长信量化中小盘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”)《关于核准长信量化中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]1360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《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》发售,募集期为:2015年1月12日至2015年1月30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2015年2月4日获得其书面确认(机构部函[2015]365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。

本基金募集资金总额人民币868,621,104.74元,利息转份额人民币为725,297.66元,募集规模为869,346,402.40份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振字第1500177号验资报

告。

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、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化中小盘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（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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款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（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%-95%，投资于中小盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、银行定期存款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的比例范围是基金资产的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。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。

本基金业绩比较基准为：中证700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

本基金的财务报表按照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”）的要求编制，同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券业协会于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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况、2015年2月4日至2015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 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易

日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-金融所转移金融资产的账面价值

-结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分

后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性

金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

根据《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。经营分部，是指本基金内同时满足下列条件的组

成部分：

- 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在交易所和银行间同业市场交易的债券品种（可转债除外），根据《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。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》，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。

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制, 是指本基金拥有对被投资方的权力, 通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报, 并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本基金是否拥有对被投资方的权力时, 本基金仅考虑与被投资方相关的实质性权利(包括本基金自身所享有的及其他方所享有的实质性权利)。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策无变更。

6.4.5.2 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》。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错。

6.4.6 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]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》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) 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。

(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) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	61,563,293.57
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	61,563,293.57

6.4.7.2 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	189,910,669.80	191,712,619.80	1,801,950.00
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
其他	—	—	—
合计	189,910,669.80	191,712,619.80	1,801,950.00

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 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。

6.4.7.5 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	12,272.83
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	984.95
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	4.89
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	217.08
合计	13,479.75

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 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	1,529,697.83
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,529,697.83

6.4.7.8 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	44,599.40
预提信息披露费-上证报	35,528.43
预提信息披露费-中证报	35,528.43
预提信息披露费-证券时报	35,528.43
预提审计费	31,087.56
合计	182,272.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	869,346,402.40	869,346,402.40
本期申购	73,303,223.08	73,303,223.08
本期赎回（以“-”号填列）	-743,526,510.24	-743,526,510.24
本期末	199,123,115.24	199,123,115.24

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金本报告期为2015年2月4日至2015年6月30日，本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	181,752,636.14	1,801,950.00	183,554,586.14
本期基金份额交易产生的变动数	-84,358,212.83	-41,962,303.05	-126,320,515.88
其中：基金申购款	21,365,645.17	7,666,570.25	29,032,215.42
基金赎回款	-105,723,858.00	-49,628,873.30	-155,352,731.30
本期已分配利润	—	—	—
本期末	97,394,423.31	-40,160,353.05	57,234,070.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
活期存款利息收入	606,056.11
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	851,389.84
其他	1,506.38
合计	1,458,952.33

注：其他为申购款利息收入4.89元，保证金利息收入1,501.49元。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年 6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	183,790,081.60
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	183,790,081.60

6.4.7.12.2 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2月4日（基金合同生效日）至2015年 6月30日
卖出股票成交总额	1,234,364,442.98
减：卖出股票成本总额	1,050,574,361.38
买卖股票差价收入	183,790,081.60

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
----	-------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,151,390.12
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,151,390.12

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	1,801,950.00
——股票投资	1,801,950.00
——债券投资	—
——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	1,801,950.00

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	3,094,111.77
转换费收入	95,302.18
合计	3,189,413.95

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	3,543,708.84
银行间市场交易费用	—
合计	3,543,708.84

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
审计费用	31,087.56

信息披露费	106,585.29
交易费用_回购	—
权证	—
账户维护费	—
划款手续费	9,720.68
其他费用	400.00
合计	147,793.53

注：其他费用为银行手续费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2015年2月4日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	841,323,584.16	34.03%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

关联方名称	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	1,400,000,000.00	70.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

。

关联方名称	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）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	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	686,229.05	33.84%	645,999.31	42.23%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,835,715.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,856,141.08

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	639,286.01

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2015年2月4日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	61,563,293.57	606,056.11

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2,349,183.79元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
------	------	------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------

长信量化中小盘股票型证券投资基金2015年半年度报告

600561	江西长运	2015-06-12	重大事项	20.59	-	-	51	639.92	1,050.09
600719	大连热电	2015-06-11	重大事项	14.83	-	-	245050	2,599,508.00	3,634,091.50
600734	实达集团	2015-06-19	重大事项	9.96	-	-	57	327.82	567.72
601877	正泰电器	2015-06-29	重大事项	30.81	-	-	112	3,641.35	3,450.72
000691	亚太实业	2015-06-26	重大事项	10.41	-	-	151,254	1,037,937.56	1,574,554.14
000959	首钢股份	2015-06-05	重大事项	6.19	-	-	44,500	217,160.00	275,455.00
002003	伟星股份	2015-06-29	重大事项	13.69	-	-	397,192	4,956,202.17	5,437,558.48
002020	京新药业	2015-06-08	重大事项	29.44	-	-	191,722	4,188,273.12	5,644,295.68
002045	国光电器	2015-06-29	重大事项	11.55	2015-07-14	12.53	345,012	3,691,402.25	398,4888.60
002199	东晶电子	2015-06-30	重大事项	17.26	-	-	133,600	1,671,339.83	2,305,936.00
002212	南洋股份	2015-05-12	重大事项	13.07	-	-	191,302	2,032,898.44	2,500,317.14
002278	神开股份	2015-06-24	重大事项	13.35	-	-	280,161	3,735,139.03	3,740,149.35
002354	天神娱乐	2015-06-25	重大事项	69.62	2015-07-23	87.27	400	39,622.41	27,848.00
002374	丽鹏股份	2015-06-30	重大事项	23.34	2015-07-13	22.50	149,251	3,464,755.97	3,483,518.34
002377	国创高新	2015-06-26	重大事项	13.32	2015-07-03	11.99	326,135	4,223,234.42	4,344,118.20
002511	中顺洁柔	2015-06-26	重大事项	12.61	2015-07-14	12.76	291,296	3,714,180.48	3,673,242.56
002545	东方铁塔	2015-06-09	重大事项	28.38	-	-	115,100	2,655,135.20	3,266,538.00
002557	洽洽食品	2015-06-029	重大事项	16.38	-	-	229,507	4,516,771.92	3,759,324.66
002662	京威股份	2015-06-30	重大事项	17.82	-	-	228,866	4227,337.97	4,078,392.12
002669	康达新材	2015-06-30	重大事项	24.10	2015-08-04	19.99	73,231	1,409,119.74	1764,867.10
002670	华声股份	2015-06-12	重大事项	21.52	-	-	149,200	2,607,979.00	3,210,784.00
300071	华谊嘉信	2015-05-21	重大事项	12.95	-	-	314,460	3,913,491.55	4,072,257.00
300084	海默科技	2015-06-25	重大事项	18.95	2015-07-20	19.29	350,201	5,832,242.15	6,636,308.95
300162	雷曼光电	2015-06-25	重大事项	26.26	-	-	103,267	2,579,846.44	2,711,791.42

300195	长荣股份	2015-06-30	重大事项	28.35	-	-	117,081	4,092,654.41	3,319,246.35
300291	华录百纳	2015-06-30	重大事项	37.76	2015-7-13	34.65	121,976	4,923,404.02	4,605,813.76
300294	博雅生物	2015-04-23	重大事项	78.82	-	-	33,300	2,070,171.32	2,624,706.00

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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交通银行，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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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	61,563,293.57	—	—	—	—	61,563,293.57
结算备付金	2,349,183.79	—	—	—	—	2,349,183.79
存出保证金	536,023.53	—	—	—	—	536,023.53
交易性金融资产	—	—	—	—	191,712,619.80	191,712,619.80
应收证券清算款	—	—	—	—	24,677,252.62	24,677,252.62
应收利息	—	—	—	—	13,479.75	13,479.75
应收申购款	—	—	—	—	1,002,787.58	1,002,787.58
资产总计	64,448,500.89	—	—	—	217,406,139.75	281,854,640.64
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	23,237,100.10	23,237,100.10
应付管理人报酬	—	—	—	—	470,044.24	470,044.24
应付托管费	—	—	—	—	78,340.72	78,340.72
应付交易费用	—	—	—	—	1,529,697.83	1,529,697.83
其他负债	—	—	—	—	182,272.25	182,272.25
负债总计	—	—	—	—	25,497,455.14	25,497,455.14
利率敏感度缺口	64,448,500.89	—	—	—	191,908,684.61	256,357,185.50

注：1、本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金；无上年度末数据；

2、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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	191,712,619.80	74.78
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	191,712,619.80	74.78

注：本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金；无上年度末数据。

6.4.13.4.3.2 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)
	VaR值为2.13%	-5,460,408.05

注：本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，为报告期内合同生效的基金；无上年度末数据。

6.4.14 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2014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	114,617,948.92	77,094,670.88	-	191,712,619.80
债券投资	—	—	-	—
合计	114,617,948.92	77,094,670.88	—	191,712,619.80

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	191,712,619.80	68.02
	其中：股票	191,712,619.80	68.02
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	63,912,477.36	22.68
7	其他资产	26,229,543.48	9.31
8	合计	281,854,640.64	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	—	—
B	采矿业	6,636,308.95	2.59
C	制造业	166,248,135.88	64.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,744,972.62	2.24
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,801,679.36	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,050.09	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,848.00	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,574,554.14	0.61
L	租赁和商务服务业	4,072,257.00	1.59
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	4,605,813.76	1.80
S	综合	—	—
	合计	191,712,619.80	74.78

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	300345	红宇新材	157,293	6,688,098.36	2.61
2	300084	海默科技	350,201	6,636,308.95	2.59
3	002020	京新药业	191,722	5,644,295.68	2.20
4	300137	先河环保	239,539	5,480,652.32	2.14
5	002003	伟星股份	397,192	5,437,558.48	2.12
6	000929	兰州黄河	239,812	5,151,161.76	2.01
7	601677	明泰铝业	300,339	4,916,549.43	1.92
8	300291	华录百纳	121,976	4,605,813.76	1.80
9	002719	麦趣尔	65,165	4,562,201.65	1.78
10	002377	国创高新	326,135	4,344,118.20	1.69
11	002328	新朋股份	299,637	4,194,918.00	1.64
12	002580	圣阳股份	235,256	4,173,441.44	1.63
13	002566	益盛药业	181,965	4,136,064.45	1.61
14	002662	京威股份	228,866	4,078,392.12	1.59
15	300071	华谊嘉信	314,460	4,072,257.00	1.59
16	002433	太安堂	250,297	4,044,799.52	1.58
17	002045	国光电器	345,012	3,984,888.60	1.55
18	002536	西泵股份	78,195	3,962,140.65	1.55
19	600613	神奇制药	154,472	3,914,320.48	1.53
20	002557	洽洽食品	229,507	3,759,324.66	1.47
21	002278	神开股份	280,161	3,740,149.35	1.46
22	002511	中顺洁柔	291,296	3,673,242.56	1.43
23	000725	京东方A	707,285	3,670,809.15	1.43
24	000533	万家乐	291,337	3,638,799.13	1.42
25	600719	大连热电	245,050	3,634,091.50	1.42
26	002374	丽鹏股份	149,251	3,483,518.34	1.36
27	300195	长荣股份	117,081	3,319,246.35	1.29
28	002623	亚玛顿	75,393	3,287,134.80	1.28

29	002545	东方铁塔	115,100	3,266,538.00	1.27
30	002572	索菲亚	83,601	3,229,506.63	1.26
31	002670	华声股份	149,200	3,210,784.00	1.25
32	000637	茂化实华	252,942	3,197,186.88	1.25
33	300327	中颖电子	149,486	3,179,567.22	1.24
34	300258	精锻科技	197,585	3,072,446.75	1.20
35	002324	普利特	86,840	3,013,348.00	1.18
36	000593	大通燃气	215,636	2,801,111.64	1.09
37	300162	雷曼光电	103,267	2,711,791.42	1.06
38	000756	新华制药	222,716	2,692,636.44	1.05
39	300061	康耐特	183,670	2,672,398.50	1.04
40	300294	博雅生物	33,300	2,624,706.00	1.02
41	300179	四方达	246,508	2,546,427.64	0.99
42	002212	南洋股份	191,302	2,500,317.14	0.98
43	300100	双林股份	128,388	2,443,223.64	0.95
44	300286	安科瑞	81,434	2,434,062.26	0.95
45	002365	永安药业	116,838	2,360,127.60	0.92
46	002199	东晶电子	133,600	2,305,936.00	0.90
47	300325	德威新材	131,574	2,302,545.00	0.90
48	002538	司尔特	169,550	2,256,710.50	0.88
49	002514	宝馨科技	86,340	2,162,817.00	0.84
50	300335	迪森股份	123,878	2,110,881.12	0.82
51	002107	沃华医药	69,473	2,100,168.79	0.82
52	300292	吴通通讯	58,311	1,972,661.13	0.77
53	300139	福星晓程	88,342	1,793,342.60	0.70
54	002669	康达新材	73,231	1,764,867.10	0.69
55	000691	亚太实业	151,254	1,574,554.14	0.61
56	300108	双龙股份	50,717	863,203.34	0.34
57	000959	首钢股份	44,500	275,455.00	0.11
58	002354	天神娱乐	400	27,848.00	0.01
59	601877	正泰电器	112	3,450.72	0.00
60	002563	森马服饰	86	2,077.76	0.00
61	600444	*ST国通	88	1,921.04	0.00
62	002681	奋达科技	45	1,235.70	0.00
63	600561	江西长运	51	1,050.09	0.00
64	600734	实达集团	57	567.72	0.00
65	002547	春兴精工	12	416.52	0.00
66	000572	海马汽车	39	327.21	0.00
67	300062	中能电气	3	61.35	0.00
68	600105	永鼎股份	2	45.52	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	16,873,163.02	6.58
2	601169	北京银行	15,531,188.90	6.06
3	600016	民生银行	14,867,606.47	5.80
4	601677	明泰铝业	13,649,619.18	5.32
5	600015	华夏银行	12,173,582.95	4.75
6	601788	光大证券	11,342,912.66	4.42
7	601939	建设银行	11,132,524.00	4.34
8	002142	宁波银行	11,085,408.74	4.32
9	601009	南京银行	10,915,308.72	4.26
10	600613	神奇制药	10,614,445.70	4.14
11	601377	兴业证券	10,502,186.57	4.10
12	600038	中直股份	9,711,578.82	3.79
13	300137	先河环保	9,017,455.09	3.52
14	300117	嘉寓股份	8,995,975.44	3.51
15	002433	太安堂	8,923,580.46	3.48
16	600823	世茂股份	8,859,581.00	3.46
17	600007	中国国贸	8,760,270.60	3.42
18	601877	正泰电器	8,540,238.93	3.33
19	600369	西南证券	8,396,899.00	3.28
20	002328	新朋股份	8,377,381.49	3.27
21	002580	圣阳股份	8,283,780.27	3.23
22	002045	国光电器	8,253,908.50	3.22
23	300108	双龙股份	8,199,847.64	3.20
24	601555	东吴证券	8,168,544.15	3.19
25	002087	新野纺织	7,949,921.10	3.10
26	002380	科远股份	7,929,060.50	3.09
27	000929	兰州黄河	7,918,950.00	3.09
28	300335	迪森股份	7,885,377.00	3.08
29	601099	太平洋	7,873,718.00	3.07
30	600582	天地科技	7,841,144.39	3.06
31	000686	东北证券	7,790,665.00	3.04
32	000563	陕国投A	7,448,791.40	2.91
33	000637	茂化实华	7,261,285.40	2.83
34	601601	中国太保	7,248,715.00	2.83

35	002194	武汉凡谷	7,215,896.53	2.81
36	300292	吴通通讯	7,187,392.00	2.80
37	600837	海通证券	7,152,382.00	2.79
38	000750	国海证券	6,988,995.35	2.73
39	300084	海默科技	6,976,701.76	2.72
40	002593	日上集团	6,949,895.10	2.71
41	601901	方正证券	6,946,618.27	2.71
42	002500	山西证券	6,942,934.00	2.71
43	002536	西泵股份	6,756,448.24	2.64
44	600583	海油工程	6,672,008.76	2.60
45	000572	海马汽车	6,570,230.66	2.56
46	000756	新华制药	6,563,488.70	2.56
47	300291	华录百纳	6,469,678.80	2.52
48	002557	洽洽食品	6,454,348.08	2.52
49	000725	京东方A	6,442,036.00	2.51
50	300179	四方达	6,295,938.97	2.46
51	002324	普利特	6,287,318.00	2.45
52	600356	恒丰纸业	6,215,680.34	2.42
53	002088	鲁阳股份	6,198,883.91	2.42
54	300327	中颖电子	6,132,087.30	2.39
55	300286	安科瑞	6,075,845.00	2.37
56	002566	益盛药业	5,999,212.54	2.34
57	300195	长荣股份	5,972,482.68	2.33
58	002003	伟星股份	5,966,669.35	2.33
59	002547	春兴精工	5,931,733.37	2.31
60	300100	双林股份	5,925,806.18	2.31
61	300258	精锻科技	5,913,879.00	2.31
62	300345	红宇新材	5,675,580.19	2.21
63	000593	大通燃气	5,651,745.00	2.20
64	002374	丽鹏股份	5,600,144.03	2.18
65	002510	天汽模	5,569,045.00	2.17
66	002365	永安药业	5,525,950.88	2.16
67	300046	台基股份	5,486,312.94	2.14
68	600444	*ST国通	5,466,592.00	2.13
69	002662	京威股份	5,464,901.42	2.13
70	002623	亚玛顿	5,354,853.19	2.09
71	002278	神开股份	5,337,262.20	2.08
72	002563	森马服饰	5,251,551.02	2.05
73	300325	德威新材	5,180,180.00	2.02
74	300061	康耐特	5,155,575.26	2.01

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	19,574,313.95	7.64
2	601169	北京银行	17,128,043.04	6.68
3	600016	民生银行	15,990,729.49	6.24
4	600015	华夏银行	14,528,927.30	5.67
5	601788	光大证券	12,291,020.74	4.79
6	601009	南京银行	12,083,698.94	4.71
7	601939	建设银行	11,948,803.00	4.66
8	002142	宁波银行	11,504,486.27	4.49
9	601377	兴业证券	10,825,076.04	4.22
10	002380	科远股份	10,481,431.58	4.09
11	600038	中直股份	10,410,166.74	4.06
12	600582	天地科技	10,145,660.86	3.96
13	002593	日上集团	9,989,321.66	3.90
14	300117	嘉寓股份	9,633,461.44	3.76
15	002087	新野纺织	9,452,278.06	3.69
16	002500	山西证券	9,245,459.00	3.61
17	601555	东吴证券	9,027,250.21	3.52
18	600369	西南证券	8,981,275.80	3.50
19	600007	中国国贸	8,893,315.60	3.47
20	000686	东北证券	8,836,254.00	3.45
21	600823	世茂股份	8,805,356.00	3.43
22	601677	明泰铝业	8,791,767.37	3.43
23	002194	武汉凡谷	8,591,633.43	3.35
24	600837	海通证券	8,125,046.82	3.17
25	601099	太平洋	8,115,803.00	3.17
26	002750	龙津药业	8,115,172.46	3.17
27	601877	正泰电器	8,104,457.25	3.16
28	002546	新联电子	7,882,473.33	3.07
29	000563	陕国投A	7,815,900.70	3.05
30	600356	恒丰纸业	7,810,442.45	3.05
31	600583	海油工程	7,509,499.79	2.93
32	002088	鲁阳股份	7,501,558.59	2.93
33	002472	双环传动	7,422,864.07	2.90
34	300108	双龙股份	7,316,523.03	2.85

35	601901	方正证券	7,271,717.28	2.84
36	000750	国海证券	7,263,999.71	2.83
37	002547	春兴精工	7,172,940.60	2.80
38	601601	中国太保	7,131,076.95	2.78
39	002290	禾盛新材	6,949,593.11	2.71
40	300302	同有科技	6,810,742.00	2.66
41	000638	万方发展	6,784,655.12	2.65
42	600370	三房巷	6,689,123.92	2.61
43	300163	先锋新材	6,670,731.77	2.60
44	300046	台基股份	6,652,737.77	2.60
45	000040	宝安地产	6,647,265.31	2.59
46	300229	拓尔思	6,424,173.86	2.51
47	600393	东华实业	6,377,203.22	2.49
48	000572	海马汽车	6,373,220.86	2.49
49	600605	汇通能源	6,351,664.96	2.48
50	002434	万里扬	6,278,243.39	2.45
51	600444	*ST国通	6,180,635.08	2.41
52	600248	延长化建	6,059,330.94	2.36
53	002397	梦洁家纺	6,045,482.00	2.36
54	002504	东光微电	6,038,679.95	2.36
55	300261	雅本化学	5,962,821.05	2.33
56	002454	松芝股份	5,882,337.00	2.29
57	000785	武汉中商	5,865,307.16	2.29
58	002510	天汽模	5,830,427.28	2.27
59	002062	宏润建设	5,807,633.00	2.27
60	000856	冀东装备	5,803,057.19	2.26
61	600900	长江电力	5,750,705.23	2.24
62	002225	濮耐股份	5,703,694.10	2.22
63	300066	三川股份	5,670,012.84	2.21
64	002238	天威视讯	5,663,624.42	2.21
65	002518	科士达	5,649,613.28	2.20
66	600243	青海华鼎	5,601,967.34	2.19
67	600613	神奇制药	5,520,613.02	2.15
68	000004	国农科技	5,494,956.69	2.14
69	000035	中国天楹	5,484,094.44	2.14
70	600529	山东药玻	5,454,101.03	2.13
71	603399	新华龙	5,450,675.62	2.13
72	002708	光洋股份	5,383,122.22	2.10
73	300230	永利带业	5,368,425.33	2.09
74	600758	红阳能源	5,336,538.68	2.08

75	300262	巴安水务	5,263,044.76	2.05
76	300219	鸿利光电	5,254,632.00	2.05
77	600353	旭光股份	5,207,980.00	2.03
78	600272	开开实业	5,199,752.99	2.03
79	600023	浙能电力	5,174,069.14	2.02
80	300431	暴风科技	5,161,075.35	2.01

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,240,485,031.18
卖出股票的收入（成交）总额	1,234,364,442.98

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

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

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	536,023.53
2	应收证券清算款	24,677,252.62
3	应收股利	—
4	应收利息	13,479.75
5	应收申购款	1,002,787.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,229,543.48

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	300084	海默科技	6,636,308.95	2.59	停牌
2	002020	京新药业	5,644,295.68	2.20	停牌
3	002003	伟星股份	5,437,558.48	2.12	停牌
4	300291	华录百纳	4,605,813.76	1.80	停牌
5	002377	国创高新	4,344,118.20	1.69	停牌

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
3,724	53,470.22	49,452.11	0.02%	199,073,663.13	99.98%

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	47,639.83	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、基金投资和研发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(2015年2月4日)基金份额总额	869,346,402.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	73,303,223.08
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	743,526,510.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	199,123,115.24

注：本基金基金合同于2015年2月4日起正式生效，本报告期为2015年2月4日至2015年6月30日。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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 报告期内基金管理人的重大人事变动

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 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		债券回购交易		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	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	841,323,584.16	34.03%	1,400,000,000.00	70.00%	686,229.05	33.84%	
兴业证券	2	611,151,061.00	24.72%	-	-	495,277.43	24.42%	
国金证券	1	573,465,281.68	23.20%	600,000,000.00	30.00%	464,734.58	22.91%	
华泰证券	2	244,617,257.56	9.89%	-	-	198,236.74	9.77%	
国泰君安	1	119,388,114.81	4.83%	-	-	108,691.39	5.36%	
华创证券	1	82,357,791.45	3.33%	-	-	74,978.65	3.70%	
广发证券	2	-	-	-	-	-	-	
申银万国	1	-	-	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	-	-	

注：1、本报告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的长江证券2个交易单元、国泰君安证券1个交易单元、华创证券1个交易单元为共用公司旗下基金长信量化先锋租用的交易单元；本报告期内本基金新增光大证券、国金证券、申银万国各1个交易单元，兴业证券、广发证券、华泰证券各2个交易单元，共计9个交易单元。

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	长信量化中小盘股票型证券投资基金基金份额发售公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-7
2	长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-7
3	长信量化中小盘股票型证券投资基金招募说明书	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-7
4	长信量化中小盘股票型证券投资基金托管协议	上证报、中证报、 证券时报	2015-1-7
5	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
6	长信基金管理有限责任公司关于长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同生效公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-2-5
7	长信基金管理有限责任公司关于长信量化中小盘股票型证券投资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长信量化中小盘股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-20
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长江证券股份有限公司开通	上证报、中证报、 证券时报、证券日	2015-3-23

	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	报	
10	长信基金管理有限责任公司关于长信量化中小盘股票型证券投资基金在交通银行股份有限公司等基金销售机构开通转换、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
11	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
12	长信基金管理有限责任公司关于增加中信证券(浙江)有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-24
13	长信基金管理有限责任公司关于增加招商证券股份有限公司为长信量化中小盘股票型证券投资基金代销机构的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-3-25
14	长信基金管理有限责任公司关于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参加“长金通”网上直销费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-3-27
15	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
16	长信基金管理有限责任公司关于在中国建设银行股份有限公司开通长信量化中小盘股票型证券投资基金转换业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-3-30
17	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
18	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
19	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
20	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	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-6-25

	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	报	
21	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中小盘股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《长信量化中小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化中小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化中小盘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