

长信量化先锋股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§ 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

2013年上半年度,基金托管人在长信量化先锋股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2013年上半年度,长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本报告中基金业绩指标内容的真实性、准确性和完整性发表意见

2013年上半年度,长信基金管理有限责任公司依据法律法规、基金合同及托管协议的有关规定,对长信量化先锋股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	13,893,916.78	9,199,598.06
结算备付金	554,277.10	545,603.79
存出保证金	19,223.00	500,000.00
交易性金融资产	72,208,901.99	89,633,559.78
其中:股票投资	72,208,901.99	89,633,559.78
基金投资	72,208,901.99	89,633,559.78
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	3,763,733.99	-
应收利息	2,876.85	1,749.92
应收股利	-	-
应收申购款	9,288.55	6,227.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	90,452,218.26	99,886,738.61
负债和所有者权益		
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	-	-
应付赎回款	85,507.80	899,790.28
应付管理人报酬	121,397.43	116,850.91
应付托管费	20,232.90	19,475.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	324,422.03	272,172.57
应交税费	49,844.00	49,844.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	238,399.44	524,516.82
负债合计	839,803.60	1,882,648.90
所有者权益:		
实收基金	127,744,880.82	138,508,302.11
未分配利润	-38,132,466.16	-40,504,212.40
所有者权益合计	89,612,414.66	98,004,089.71
负债和所有者权益总计	90,452,218.26	99,886,738.61

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	1,925,306.39	10,509,175.52
1.利息收入	53,909.75	215,680.66
其中:存款利息收入	53,909.75	92,164.15
债券利息收入	-	98,868.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	24,647.87
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	20,864,774.22	9,004,005.38
其中:股票投资收益	20,489,984.13	8,032,205.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	374,790.09	971,799.73
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-18,995,043.41	1,284,902.48
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	4,587.00
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,058,239.60	3,881,605.60
减:一、费用	754,637.79	1,073,914.51
1.管理人报酬	125,772.99	178,985.70
2.托管费	-	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,034,275.00	2,484,605.49
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	143,553.82	144,099.90
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-132,933.21	6,627,569.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-132,933.21	6,627,569.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	138,508,302.11	-40,504,212.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-132,933.21	-132,933.21
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-10,763,421.29	2,504,679.45
其中:1.基金申购款	2,733,633.89	-647,884.95
2.基金赎回款	-13,497,055.18	3,152,564.40
四、本期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)	127,744,880.82	-38,132,466.16
六、未分配利润	-38,132,466.16	-40,504,212.40
七、所有者权益合计	89,612,414.66	98,004,089.71

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)	187,019,663.03	-47,476,171.01
六、未分配利润	-47,476,171.01	-47,476,171.01
七、所有者权益合计	139,543,492.02	94,523,828.99

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额127,744,880.82份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	194,091,301.59	-56,030,232.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,627,569.92
三、本期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)	-7,071,638.56	1,636,491.76
其中:1.基金申购款	2,000,242.42	-477,620.00
2.基金赎回款	-9,071,880.98	2,134,111.76
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)		