

# 长信利盈灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司，根据本基金合同的规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长信利盈混合	
场内简称	长信利盈	
基金主代码	519963	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	190,947,137.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信利盈混合 A	长信利盈混合 C
下属分级基金场内简称	利盈 A	利盈 C
下属分级基金的交易代码	519963	519962
报告期末下属分级基金的份额总额	189,893,713.60 份	1,053,424.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵</p>

	活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。 4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率（税后）+3%
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	罗菲菲
	联系电话	021-61009999	010-58560666
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95568
传真		021-61009800	010-58560798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼、北京市西城区复兴门内大街 2 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

基金级别	长信利盈混合 A	长信利盈混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,048,105.20	2,710,430.80
本期利润	5,033,410.00	697,607.28
加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0023
本期基金份额净值增长率	9.78%	3.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0577	-0.0137
期末基金资产净值	210,990,576.65	1,099,310.81
期末基金份额净值	1.111	1.044

注：1、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。

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。

#### 3.2 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

###### 3.2.1.1 长信利盈混合 A 份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

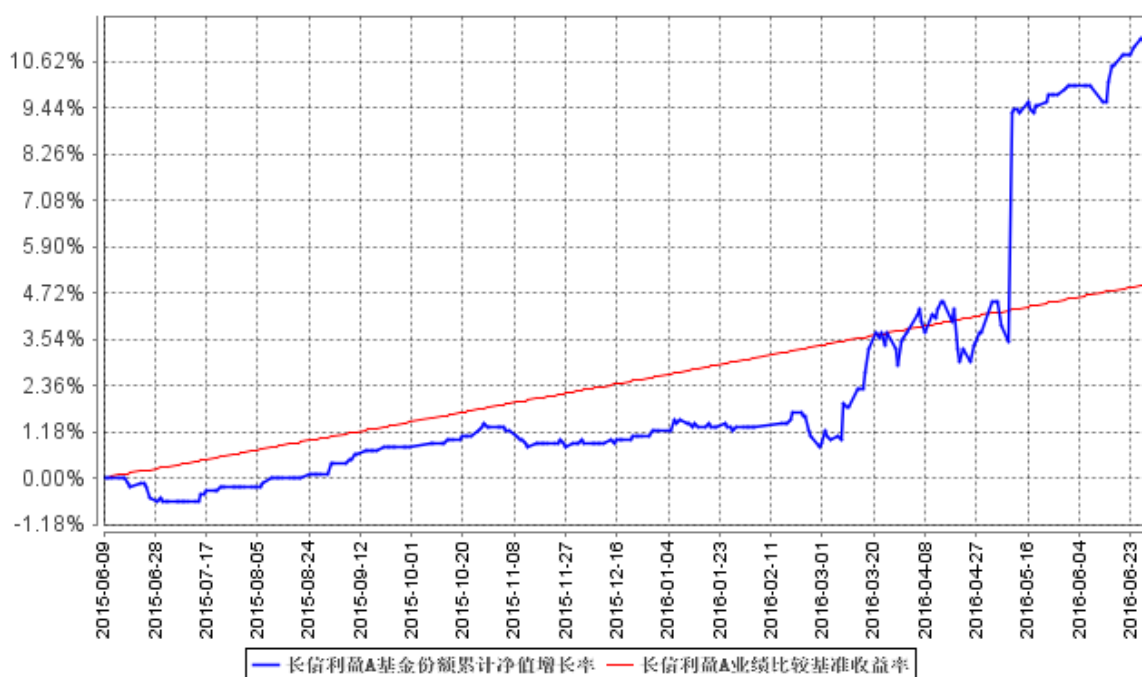
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.00%	0.17%	0.37%	0.01%	0.63%	0.16%
过去三个月	7.24%	0.76%	1.13%	0.01%	6.11%	0.75%
过去六个月	9.78%	0.57%	2.27%	0.02%	7.51%	0.55%
过去一年	11.66%	0.40%	4.74%	0.01%	6.92%	0.39%
自基金合同生效起至今	11.10%	0.39%	5.07%	0.01%	6.03%	0.38%

###### 3.2.1.2 长信利盈混合 C 份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

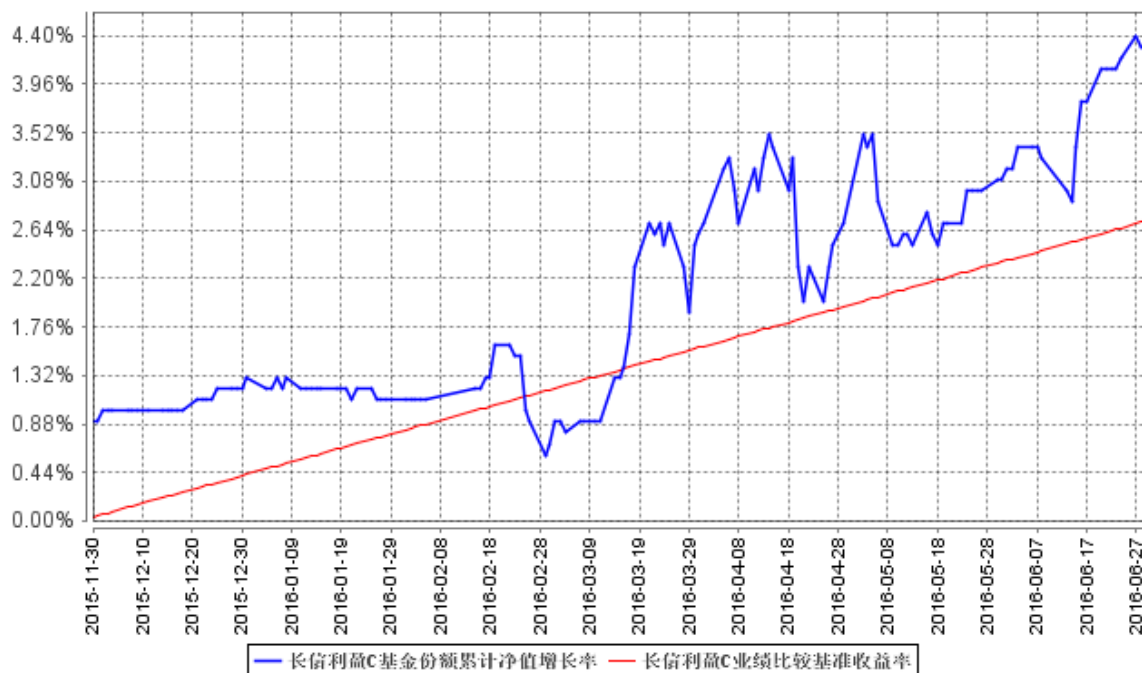
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.26%	0.18%	0.37%	0.01%	0.89%	0.17%
过去三个月	1.75%	0.27%	1.13%	0.01%	0.62%	0.26%
过去六个月	3.06%	0.23%	2.27%	0.02%	0.79%	0.21%
自基金合同生效起至今	3.47%	0.23%	2.70%	0.01%	0.77%	0.22%

### 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

#### 3.2.2.1 长信利盈混合 A 自基金合同生效以来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



### 3.2.2.2 长信利盈混合 C 自份额增加日以来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、长信利盈混合A图示日期为2015年6月9日至2016年6月30日，长信利盈混合C图示日期为2015年11月30日（份额增加日）至2016年6月30日。自基金份额增加日（2015年11月30日）至报告期期末，长信利盈混合C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已符合基金合同中的约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2016年6月30日，本基金管理人共管理37只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普100等权重指数(QDII)、长信利鑫债券(LOF)、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券(LOF)、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、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、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合(LOF)、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券、长信中证能源互联网指数(LOF)、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券(QDII)、长信先锐债券、长信利发债券。

#### 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		
刘波	本基金、长信可转债债券基金、长信利众债券基金(LOF)、长信利广混合基金、长信利保债券基金、长信富安纯债一年定开债券基	2015年6月9日	-	9年	经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011年2月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益货币基金的基金经理。现任本基金、长信可转债债券基金、长



	金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理				信利众债券基金（LOF）、长信利广混合基金、长信利保债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信利泰混合基金和长信利发债券基金的基金经理。
黄韵	本基金、长信恒利优势混合基金、长信改革红利混合基金和长信新利混合基金的基金经理	2016 年 2 月 6 日	-	10 年	金融学硕士，武汉大学研究生毕业，具备基金从业资格。曾任职于三九企业集团；2006 年加入长信基金管理有限责任公司，历任公司产品设计研究员、研究发展部行业研究员、长信金利趋势股票基金的基金经理助理。现任本基金、长信恒利优势混合基金、长信改革红利混合基金和长信新利混合基金的基金经理。
李小羽	本基金、长信可转债基金、长信利丰债券基金、长信利保债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利广混合基金、长信利富债券基金和长信利发债券基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会执行委员	2016 年 5 月 24 日	-	18 年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、固定收益部总监、总经理助理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员，本基金、长信可转债基金、长信利丰债券基金、长信利保债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利

					广混合基金、长信利富债券基金和长信利发债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且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

上半年，美国保持了较好的复苏态势，欧元区经济仍显低迷，6 月份英国脱欧事件超出市场预期，对各经济体的影响较为复杂。美国再次加息预期回落，避险情绪升温，美元升值，黄金价格上行，主要经济体国债收益率下行，欧元区及新兴经济体汇率普遍贬值。国内方面，受益于年初信贷刺激，上半年房地产及基建投资增速整体上行，对经济增长起到托底作用，二季度信贷投放规模回归正常，经济刺激意愿减弱，增长预期趋于稳定；上半年通胀冲高回落，通胀预期减弱；央行继续通过准备金率、公开市场操作及定向工具维持市场资金面稳定。市场方面，一季度债券利率震荡下行，4 月份信用违约事件爆发导致债券市场出现一定幅度调整，5-6 月份随着经济增长预期、通胀预期的回落，叠加脱欧因素，债券收益率普遍下行；可转债一级市场供给加速，二级市场估值仍处于压缩通道，整体表现为震荡格局。

报告期内，本基金结合规模变动因素逐渐调整了债券仓位及结构，具体而言，一季度本基金配置了中短期纯债和中长期利率债品种，二季度本基金加大了中短期城投债配置比例，以期获得稳定的投资收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信利盈混合 A 份额净值为 1.111 元，份额累计净值为 1.111 元，本报告期长信利盈混合 A 净值增长率为 9.78%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%；长信利盈混合 C 份额净值为 1.044 元，份额累计净值为 1.044 元，本报告期长信利盈混合 C 净值增长率为 3.06%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，英国脱欧事件的影响可能历时较长，后续不确定性因素仍较大，表现为经济增速的下行压力和各国汇率的再平衡，短期内货币政策可能是相机抉择。国内而言，供给侧改革力度的加大和管理层刺激意愿的减弱可能使经济继续面临下行压力，脱欧因素导致汇率波动加大，短期内通胀有下行趋势，但通胀预期值得关注，货币政策在增长、汇率和通胀之间寻找平衡，短期来看可能继续维持稳定。就市场而言，避险情绪升温及通胀的阶段性回落可能使债市面临较好的环境，利率债和高等级信用债均有一定机会；受益于地方政府债务置换规模的扩大，信用债中城投债仍是相对较好的投资品种，产业债中所处供给侧改革领域的个券信用风险暴露可能进一步加大，信用债标的需要加强个券筛选；可转债一级市场供给加速，新增标的有利于化解存量转债的

估值压力，等待时机寻找其中交易性机会。下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，进一步优化投资组合，争取为投资人提供安全、稳健的投资收益。

#### 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、股票交易部总监、量化投资部总监、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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 3、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；
- 4、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；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人—长信基金管理有限责任公司在长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长信利盈灵活配置混合型证券投资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

由长信利盈混合基金的基金管理人—长信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	35,105,939.99	156,940,940.57
结算备付金	403,919.28	31,705,628.11
存出保证金	88,963.67	214,524.34
交易性金融资产	176,692,818.65	117,672,073.02
其中：股票投资	12,590,818.65	52,577,573.02
基金投资	-	-
债券投资	164,102,000.00	65,094,500.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	2,383,683,033.52
应收证券清算款	-	96,153.35
应收利息	2,726,942.74	3,974,793.50
应收股利	-	-
应收申购款	143,730.52	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	215,162,314.85	2,694,287,146.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,444,874.50	-
应付赎回款	84,667.06	-
应付管理人报酬	106,291.10	1,322,645.11
应付托管费	17,715.19	220,440.86
应付销售服务费	1,268.22	217,772.37
应付交易费用	148,667.18	51,912.91

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	268,944.14	210,000.00
负债合计	3,072,427.39	2,022,771.25
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	190,947,137.60	2,659,121,650.93
未分配利润	21,142,749.86	33,142,724.23
所有者权益合计	212,089,887.46	2,692,264,375.16
负债和所有者权益总计	215,162,314.85	2,694,287,146.41

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.111元，基金份额总额190,947,137.60份。其中长信利盈混合A基金份额净值1.111元，份额总额189,893,713.60份，长信利盈混合C基金份额净值1.044元，份额总额1,053,424.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
<b>一、收入</b>	9,359,751.46	-16,469,740.41
1.利息收入	9,285,048.30	1,655,837.04
其中：存款利息收入	722,374.32	406,569.00
债券利息收入	3,811,964.08	25.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,750,709.90	1,249,242.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-362,013.54	-13,933,660.71
其中：股票投资收益	1,557,698.00	-14,030,364.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,954,322.87	96,704.26
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	34,611.33	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,027,518.72	-4,200,717.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,464,235.42	8,800.28

<b>减：二、费用</b>	3,628,734.18	1,348,831.72
1. 管理人报酬	2,230,655.68	569,329.16
2. 托管费	371,775.93	94,888.18
3. 销售服务费	408,057.21	-
4. 交易费用	375,358.33	661,582.14
5. 利息支出	13,001.92	-
其中：卖出回购金融资产支出	13,001.92	-
6. 其他费用	229,885.11	23,032.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	5,731,017.28	-17,818,572.13
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	5,731,017.28	-17,818,572.13

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,659,121,650.93	33,142,724.23	2,692,264,375.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,731,017.28	5,731,017.28
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）	-2,468,174,513.33	-17,730,991.65	-2,485,905,504.98
其中：1.基金申购款	242,246,585.57	18,705,214.57	260,951,800.14
2.基金赎回款	-2,710,421,098.90	-36,436,206.22	-2,746,857,305.12
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)	190,947,137.60	21,142,749.86	212,089,887.46
项目	上年度可比期间 2015年6月9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)	270,946,626.82	-	270,946,626.82
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	-17,818,572.13	-17,818,572.13
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数 (净值减少以“-”号 填列)	4,895,461,382.27	-10,062,193.71	4,885,399,188.56
其中：1.基金申购款	4,896,638,211.34	-10,066,159.90	4,886,572,051.44
2.基金赎回款	-1,176,829.07	3,966.19	-1,172,862.88
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)	5,166,408,009.09	-27,880,765.84	5,138,527,243.25

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

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：

覃波  
基金管理人负责人

覃波  
主管会计工作负责人

孙红辉  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予长信利盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(中

中国证监会证监许可[2015]919号批准，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年6月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

本基金于2015年6月1日至2015年6月4日募集，募集资金总额人民币270,898,366.14元，利息转份额人民币48,260.68元，募集规模为270,946,626.82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验字第1500367号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信利盈灵活配置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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%；债券、债券回购、货币市场工具、银行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占基金资产的5%-100%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：银行一年期定期存款利率(税后)+3%。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.4.1 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

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

### 6.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[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[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》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、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税

率计征个人所得税。

(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。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 9 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	111,650,599.31	49.08%	245,589,754.90	55.93%

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

##### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比例
长江证券	403,368,090.75	100.00%	405,730.00	100.00%

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至

2015 年 6 月 30 日。

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长江证券	12,308,000,000.00	90.51%	13,265,000,000.00	96.65%

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	103,978.72	49.07%	60,362.89	41.40%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 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	223,583.87	55.93%	223,583.87	55.93%

注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰(0.9‰)-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰(0.9‰)-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金的基金管理人在租用长江证券证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从长江证券获得证券研究综合服务。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 9 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	2,230,655.68	569,329.16
其中：支付销售机构的客户维护费	4,291.42	-

注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提，按月支付。

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

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 9 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	371,775.93	94,888.18

注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率逐日计提，按月支付。

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

### 6.4.7.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利盈 A	长信利盈 C	合计
长信基金管理有限责任公司	-	408,057.21	408,057.21
合计	-	-	-

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 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销售服务费	
	长信利盈	合计
合计	-	-

注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.25% 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销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 9 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	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	35,105,939.99	552,667.84	1,356,472,459.08	296,844.52

注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 9 日起正式生效。上年度可比期间为 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、本基金通过“民生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 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 403,919.28 元。(2015 年 12 月 31 日：人民币 31,705,628.11 元)。

**6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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由关联方承销的证券。

**6.4.7.7 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。

**6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金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股票。

**6.4.8.1 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
002101	广东鸿图	2016年5月3日	临时停牌	21.62	-	-	136,365	2,750,132.91	2,948,211.30	-
300166	东方国信	2016年6月8日	临时停牌	27.47	-	-	50,000	1,349,676.41	1,373,500.00	-

**6.4.8.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

**§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	12,590,818.65	5.85
	其中：股票	12,590,818.65	5.85
2	固定收益投资	164,102,000.00	76.27
	其中：债券	164,102,000.00	76.27
	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	35,509,859.27	16.50
7	其他各项资产	2,959,636.93	1.38
8	合计	215,162,314.85	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港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	8,929,318.65	4.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,661,500.00	1.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,590,818.65	5.94

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002101	广东鸿图	136,365	2,948,211.30	1.39
2	002402	和而泰	99,967	2,704,107.35	1.27
3	002410	广联达	160,000	2,288,000.00	1.08
4	300322	硕贝德	90,000	1,935,000.00	0.91
5	300166	东方国信	50,000	1,373,500.00	0.65
6	600745	中茵股份	50,000	1,342,000.00	0.63

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

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002402	和而泰	11,201,220.59	0.42
2	600332	白云山	8,592,928.44	0.32
3	002410	广联达	7,319,421.35	0.27
4	600666	奥瑞德	7,171,961.92	0.27
5	300131	英唐智控	6,222,311.50	0.23
6	600804	鹏博士	4,818,718.21	0.18
7	300020	银江股份	3,922,176.93	0.15
8	600699	均胜电子	3,895,177.00	0.14
9	603005	晶方科技	3,827,109.00	0.14
10	300166	东方国信	3,779,093.94	0.14
11	600446	金证股份	3,567,601.00	0.13
12	600702	沱牌舍得	3,425,100.83	0.13
13	300045	华力创通	3,267,515.00	0.12
14	000858	五粮液	2,819,503.00	0.10
15	600718	东软集团	2,725,336.60	0.10
16	300059	东方财富	2,254,000.00	0.08

17	002123	荣信股份	2,000,000.00	0.07
18	300322	硕贝德	1,955,307.50	0.07
19	002519	银河电子	1,953,841.00	0.07
20	603898	好莱客	1,452,950.00	0.05

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	601398	工商银行	13,683,100.00	0.51
2	000001	平安银行	12,813,752.36	0.48
3	002402	和而泰	9,358,294.60	0.35
4	600332	白云山	8,372,371.97	0.31
5	300131	英唐智控	6,318,052.72	0.23
6	600666	奥瑞德	5,364,678.60	0.20
7	002410	广联达	4,866,301.94	0.18
8	600050	中国联通	4,525,482.22	0.17
9	600804	鹏博士	4,186,120.00	0.16
10	300020	银江股份	4,092,785.92	0.15
11	600699	均胜电子	3,824,218.00	0.14
12	603005	晶方科技	3,800,451.00	0.14
13	002101	广东鸿图	3,743,311.00	0.14
14	600702	沱牌舍得	3,585,540.00	0.13
15	600446	金证股份	3,450,398.00	0.13
16	300045	华力创通	3,373,968.00	0.13
17	000858	五粮液	2,875,088.10	0.11
18	600718	东软集团	2,711,863.00	0.10
19	300166	东方国信	2,438,012.00	0.09
20	300059	东方财富	2,228,000.00	0.08

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

买入股票成本（成交）总额	95,244,121.41
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	132,264,984.95
--------------	----------------

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,958,000.00	9.41
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	103,814,000.00	48.95
5	企业短期融资券	20,088,000.00	9.47
6	中期票据	20,242,000.00	9.54
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	164,102,000.00	77.37

## 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	127126	15 遂富源	200,000	21,038,000.00	9.92
2	101369002	13 电科院 MTN002	200,000	20,242,000.00	9.54
3	011599894	15 大渡河 SCP002	200,000	20,088,000.00	9.47
4	160406	16 农发 06	200,000	19,958,000.00	9.41
5	1480259	14 安吉债	100,000	10,940,000.00	5.16

## 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	88,963.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,726,942.74
5	应收申购款	143,730.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,959,636.93

**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	002101	广东鸿图	2,948,211.30	1.39	临时停牌
2	300166	东方国信	1,373,500.00	0.65	临时停牌

**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

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
长信利盈 A	892	212,885.33	182,814,442.41	96.27%	7,079,271.19	3.73%
长信利盈 C	5	210,684.80	990,099.01	93.99%	63,324.99	6.01%
合计	897	212,873.06	183,804,541.42	96.26%	7,142,596.18	3.74%

### 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	长信利盈 A	0.00	0.00%
	长信利盈 C	9.90	0.00%
	合计	9.90	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	长信利盈 A	0
	长信利盈 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利盈 A	0
	长信利盈 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利盈 A	长信利盈 C
基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额	270,946,626.82	-
本报告期期初基金份额总额	1,543,975,775.58	1,115,145,875.35
本报告期基金总申购份额	192,776,155.86	49,470,429.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,546,858,217.84	1,163,562,881.06
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	189,893,713.60	1,053,424.00



## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

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《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 10.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期本基金未更换为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	115,858,507.05	50.92%	107,899.19	50.93%	-
长江证券	2	111,650,599.31	49.08%	103,978.72	49.07%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
山西证券（退租）	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安（退租）	1	-	-	-	-	-
上海证券（退租）	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比例		券回购成交总额的比例		成交总额的比例
兴业证券	-	-	1,290,000,000.00	9.49%	-	-
长江证券	403,368,090.75	100.00%	12,308,000,000.00	90.51%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
山西证券（退租）	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安（退租）	-	-	-	-	-	-
上海证券（退租）	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

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

### （1）选择标准：

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

(2) 选择程序：

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

长信基金管理有限责任公司  
2016 年 8 月 26 日