

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

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 重要提示及目录

1.1 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。

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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
其他相关资料.....	6
2.5.....	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43

7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利盈灵活配置混合型证券投资基金	
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>本基金将结合定性分析与定量分析，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，灵活地调</p>

	<p>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。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>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。</p>
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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		叶焯	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、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

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	北京市西城区太平桥大街 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

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
本期加权平均净值利润率	1.27%	0.23%
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)	
期末可供分配利润	10,948,038.71	-14,435.65
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.10%	3.47%

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、期末可供分配利润为期末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

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	11.10%	0.39%	5.07%	0.01%	6.03%	0.38%

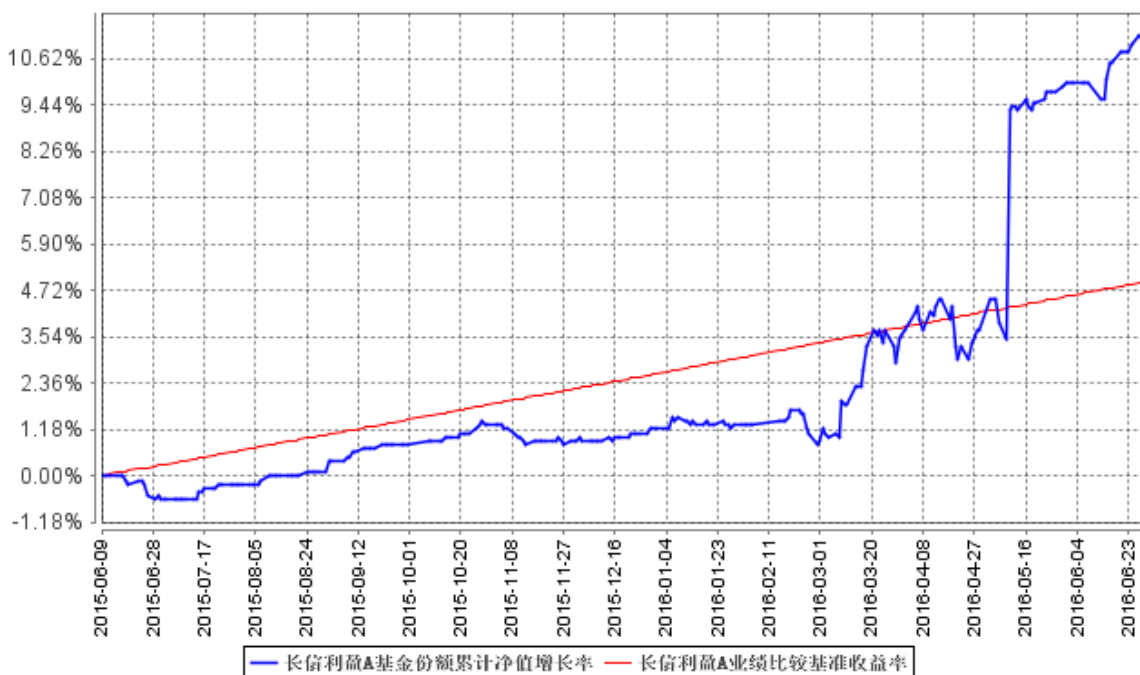
效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

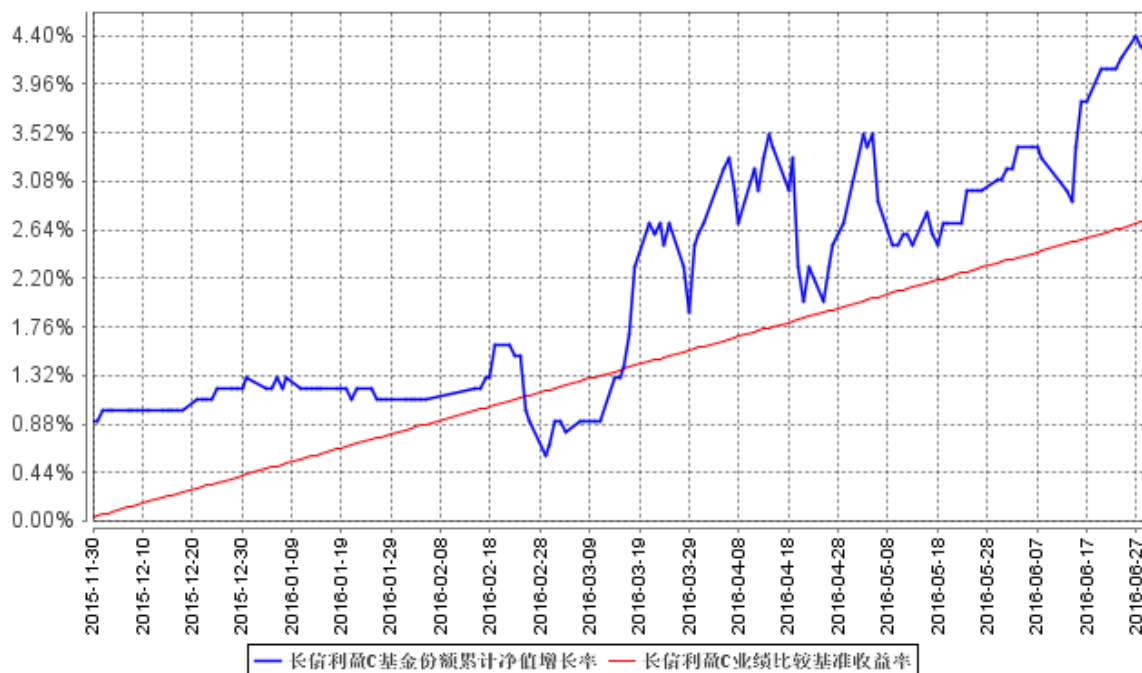
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.26%	0.18%	0.37%	0.01%	0.89%	0.17%
过去三个月	1.75%	0.27%	1.13%	0.01%	0.62%	0.26%
过去六个月	3.06%	0.23%	2.27%	0.02%	0.79%	0.21%
自基金合同生效起至今	3.47%	0.23%	2.70%	0.01%	0.77%	0.22%

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，产业债中处于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	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	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	6.4.6.2	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	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	2,383,683,033.52
应收证券清算款		-	96,153.35
应收利息	6.4.6.5	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	6.4.6.6	-	-
资产总计		215,162,314.85	2,694,287,146.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		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	6.4.6.7	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	6.4.6.8	268,944.14	210,000.00
负债合计		3,072,427.39	2,022,771.25
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	190,947,137.60	2,659,121,650.93
未分配利润	6.4.6.10	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	附注号	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
一、收入		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	6.4.6.11	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	6.4.6.12	1,557,698.00	-14,030,364.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-1,954,322.87	96,704.26
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	-

股利收益	6.4.6.15	34,611.33	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	-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）	6.4.6.17	3,464,235.42	8,800.28
减：二、费用		3,628,734.18	1,348,831.72
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	2,230,655.68	569,329.16
2. 托管费	6.4.9.2.2	371,775.93	94,888.18
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	408,057.21	-
4. 交易费用	6.4.6.18	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	6.4.6.19	229,885.11	23,032.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,731,017.28	-17,818,572.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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	-2,468,174,513.33	-17,730,991.65	-2,485,905,504.98

填列)			
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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	35,105,939.99
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	35,105,939.99

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,386,601.22	12,590,818.65	204,217.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	71,344,000.00	2,202,775.35
	银行间市场	92,424,292.22	333,707.78
	合计	164,102,000.00	2,536,483.13
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	173,952,118.09	176,692,818.65	2,740,700.56

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	5,719.27
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	163.62
应收债券利息	2,721,019.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3.98
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	36.00
合计	2,726,942.74

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	145,792.18
银行间市场应付交易费用	2,875.00
合计	148,667.18

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	93.68
预提信息披露费-中证报	49,726.04
预提信息披露费-证券时报	49,726.04
审计费用	109,726.04
预提信息披露费-上证报	59,672.34
合计	268,944.14

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信利盈 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,543,975,775.58	1,543,975,775.58
本期申购	192,776,155.86	192,776,155.86
本期赎回(以“-”号填列)	-1,546,858,217.84	-1,546,858,217.84
- 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	189,893,713.60	189,893,713.60
长信利盈 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,115,145,875.35	1,115,145,875.35
本期申购	49,470,429.71	49,470,429.71
本期赎回(以“-”号填列)	-1,163,562,881.06	-1,163,562,881.06
- 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	1,053,424.00	1,053,424.00

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

长信利盈 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,495,155.25	-2,447,152.43	19,048,002.82
本期利润	6,048,105.20	-1,014,695.20	5,033,410.00
本期基金份额交易产生的变动数	-16,595,221.74	13,610,671.97	-2,984,549.77
其中：基金申购款	10,542,747.80	7,567,891.44	18,110,639.24
基金赎回款	-27,137,969.54	6,042,780.53	-21,095,189.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,948,038.71	10,148,824.34	21,096,863.05
长信利盈 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	10,448,904.72	3,645,816.69	14,094,721.41
本期利润	2,710,430.80	-2,012,823.52	697,607.28
本期基金份额交易产生的变动数	-13,173,771.17	-1,572,670.71	-14,746,441.88
其中：基金申购款	551,360.19	43,215.14	594,575.33
基金赎回款	-13,725,131.36	-1,615,885.85	-15,341,017.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,435.65	60,322.46	45,886.81

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	552,667.84
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	163,992.28
其他	5,714.20
合计	722,374.32

注：其他为保证金利息收入及直销申购款利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,557,698.00
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	1,557,698.00

6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	132,264,984.95
减：卖出股票成本总额	130,707,286.95
买卖股票差价收入	1,557,698.00

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 2016年1月1日至2016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	-1,954,322.87
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	-1,954,322.87

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,054,992,017.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,038,444,355.09
减：应收利息总额	18,501,985.46
买卖债券差价收入	-1,954,322.87

6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	34,611.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,611.33

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,027,518.72
——股票投资	-5,698,727.15

——债券投资	2,671,208.43
——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	-
合计	-3,027,518.72

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,205,603.75
转换费收入	2,258,631.67
合计	3,464,235.42

注：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 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	375,358.33
银行间市场交易费用	-
合计	375,358.33

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	159,124.42
帐户维护费	15,000.00
其他费用	6,034.65
合计	229,885.11

注：其他费用为银行手续费。

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

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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 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

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
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

6.4.9 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 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。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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。

6.4.9.2 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
	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）。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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）。

6.4.9.2.3 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		
	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

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 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

本报告期内基金管理人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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 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)。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内没有进行利润分配。

6.4.11 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。

6.4.11.1 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	-

6.4.11.2 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。

6.4.12 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

流动性风险

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。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、量化投资部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

6.4.12.1 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中国民生银行股份有限公司，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。

6.4.12.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,088,000.00	65,094,500.00
合计	20,088,000.00	65,094,500.00

注：未评级债券为国债、政策金融债、央行票据及超短期融资券等免评级债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

6.4.12.1.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	123,772,000.00	-
未评级	20,242,000.00	-
合计	144,014,000.00	-

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。
BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

6.4.12.2 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。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，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 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，本基金的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。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的金融工程部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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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了分类。

6.4.12.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	35,105,939.99	-	-	-	-	35,105,939.99
结算备付金	403,919.28	-	-	-	-	403,919.28
存出保证金	88,963.67	-	-	-	-	88,963.67
交易性金融资产	40,330,000.00	-	71,302,000.00	52,470,000.00	12,590,818.65	176,692,818.65
应收利息	-	-	-	-	2,726,942.74	2,726,942.74
应收申购款	99,364.07	-	-	-	44,366.45	143,730.52
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	76,028,187.01	-	71,302,000.00	52,470,000.00	15,362,127.84	215,162,314.85
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,444,874.50	2,444,874.50
应付赎回款	-	-	-	-	84,667.06	84,667.06

应付管理人报酬	-	-	-	-	106,291.10	106,291.10
应付托管费	-	-	-	-	17,715.19	17,715.19
应付销售服务费	-	-	-	-	1,268.22	1,268.22
应付交易费用	-	-	-	-	148,667.18	148,667.18
其他负债	-	-	-	-	268,944.14	268,944.14
负债总计	-	-	-	-	3,072,427.39	3,072,427.39
利率敏感度缺口	76,028,187.01	-	71,302,000.00	52,470,000.00	12,289,700.45	212,089,887.46
上年度末 2015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	156,940,940.57	-	-	-	-	156,940,940.57
结算备付金	31,705,628.11	-	-	-	-	31,705,628.11
存出保证金	214,524.34	-	-	-	-	214,524.34
交易性金融资产	65,094,500.00	-	-	-	-52,577,573.02	117,672,073.02
买入返售金融资产	2,383,680,000.00	-	-	-	-	2,383,680,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	96,153.35	96,153.35
应收利息	-	-	-	-	3,974,793.50	3,974,793.50
其他资产	-	-	-	-	3,033.52	3,033.52
资产总计	2,637,635,593.02	-	-	-	-56,651,553.39	2,694,287,146.41
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,322,645.11	1,322,645.11
应付托管费	-	-	-	-	220,440.86	220,440.86
应付销售服务费	-	-	-	-	217,772.37	217,772.37
应付交易费用	-	-	-	-	51,912.91	51,912.91
其他负债	-	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债总计	-	-	-	-	2,022,771.25	2,022,771.25
利率敏感度缺口	2,637,635,593.02	-	-	-	-54,628,782.14	2,692,264,375.16

6.4.12.3.1.2 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 （2016年6月30日）	上年度末 （2015年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	877,035.30	20,245.32
	市场利率上升 27 个基点	-877,035.30	-20,245.32

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.3.3 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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 5.94%，债券投资比例为基金资产净值的 77.37%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.12.3.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	12,590,818.65	5.94	52,577,573.02	1.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	164,102,000.00	77.37	65,094,500.00	2.42
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	176,692,818.65	83.31	117,672,073.02	4.37

6.4.12.3.3.2 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(2015 年 12 月 31 日:var 值为 0.07%)		
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 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	VaR 值为 0.37%	-784,732.58	-790,468.42

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。2015 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

6.4.13.1 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 2016 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 2016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	8,269,107.35	4,321,711.3	-	12,590,818.65
债券投资		164,102,000.00	-	164,102,000.00
合计	8,269,107.35	168,423,711.3	-	176,692,818.65

自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与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的层次。

6.4.13.2 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.13.3 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具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之间无重大差异。

§ 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	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

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

本报告期末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。

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在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016年1月4日
2	长信基金管理有限责任公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016年1月8日
3	长信基金管理有限责任公司关于在直销柜台开展旗下部分基金申购（含定期定额投资申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2016年1月13日
4	长信基金管理有限责任公司关于在直销平台开通长信利盈灵活配置混合型证券投资基金C类份额转换、定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016年1月14日
5	长信利盈灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2016年1月20日
6	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016年2月6日
7	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式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	2016年3月1日
8	关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式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	2016年3月1日
9	长信利盈灵活配置混合型证券投资基金	上证报、中证报、	2016年3月26日

	2015 年年度报告及摘要	证券时报	
10	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 7 日
11	长信利盈灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 21 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分开放式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	2016 年 5 月 11 日
13	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民生银行股份有限公司直销银行申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 12 日
14	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 24 日
15	长信基金管理有限责任公司关于长信利盈灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 30 日
16	长信基金管理有限责任公司关于提高长信利盈灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额净值精度的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 3 日
17	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陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加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	2016 年 6 月 16 日
18	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	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利盈灵活配置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。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

11.3 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
2016年8月26日