

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2016年3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、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。

基金托管人广发证券股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于2016年3月23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。

本报告期自2015年7月6日(本基金基金合同生效日)起至2015年12月31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
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告.....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	18
§ 5 托管人报告.....	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告.....	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	52
8.7 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.....	53
8.8 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.....	53
8.9 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.....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
8.12 投资组合报告附注	53
§ 9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55

9.3	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.....	55
§ 10	开放式基金份额变动.....	56
§ 11	重大事件揭示.....	57
11.1	基金份额持有人大会决议.....	57
11.2	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.....	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4	基金投资策略的改变.....	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8	其他重大事件	58
§ 12	备查文件目录.....	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长信睿进混合	
基金主代码	519957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月6日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,129,186.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信睿进混合A	长信睿进混合C
下属分级基金场内简称	睿进A	睿进C
下属分级基金的交易代码	519957	519956
报告期末下属分级基金的份额总额	17,226,366.28份	92,902,820.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置,在有效控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源,基于本基金的投资目标和投资理念,从宏观和微观两个角度进行研究,开展战略资产配置,之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合,实现组合内各类别资产的优化配置,并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</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</p>

	<p>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>本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</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	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009969
	电子邮箱	zhouyug@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95511
传真	021-61009800	020-87555129
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼	广州市天河北路183号大都会广场41楼
邮政编码	200120	510620
法定代表人	叶焯	孙树明

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、上海证券报和证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn

基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼、广州市天河北路183号大都会广场41楼
------------	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京东长安街1号东方广场东2座8层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年7月6日（基金合同生效日）-2015年12月31日	
	长信睿进混合A	长信睿进混合C
本期已实现收益	4,326,518.38	26,763,248.43
本期利润	4,161,589.56	29,344,823.95
加权平均基金份额本期利润	0.1758	0.1766
本期加权平均净值利润率	16.87%	17.14%
本期基金份额净值增长率	19.20%	18.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配利润	3,198,651.89	16,444,073.53
期末可供分配基金份额利润	0.1857	0.1770
期末基金资产净值	20,541,407.80	109,964,082.44
期末基金份额净值	1.192	1.184
3.1.3 累计期末指标	2015年末	
基金份额累计净值增长率	19.20%	18.40%

注：1、本基金基金合同生效日为2015年7月6日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

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

3.2.1.1 长信睿进混合A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

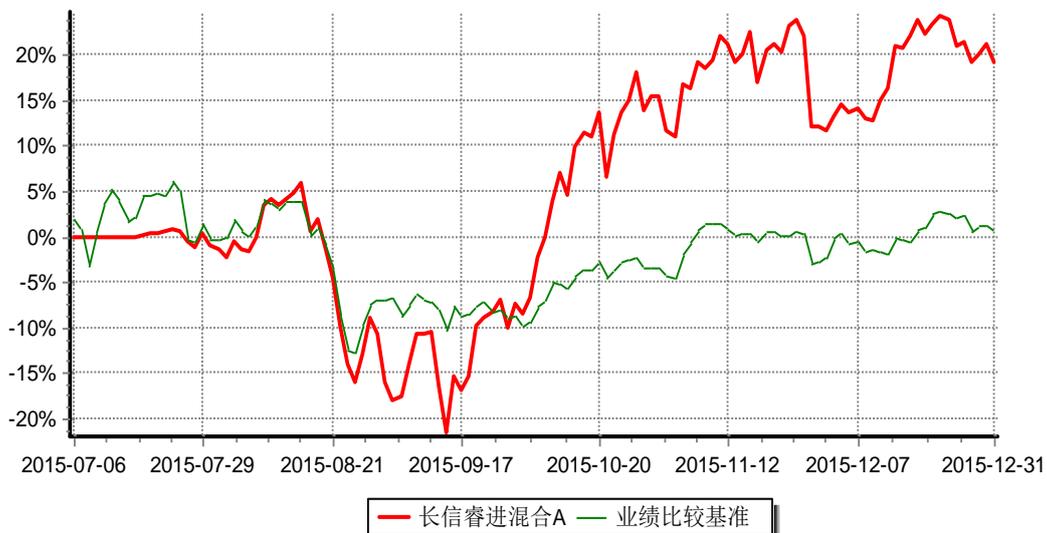
阶段 (长信睿进混合A)	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	27.90%	2.51%	11.02%	1.00%	16.88%	1.51%
自基金合同生效日起 至今(2015年7月6日 -2015年12月31日)	19.20%	2.66%	0.67%	1.56%	18.53%	1.10%

3.2.1.2长信睿进混合C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 (长信睿进混合C)	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
过去三个月	27.45%	2.52%	11.02%	1.00%	16.43%	1.52%
自基金合同生效日起 至今(2015年7月6日 -2015年12月31日)	18.40%	2.67%	0.67%	1.56%	17.73%	1.11%

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 长信睿进混合A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



3.2.2.2 长信睿进混合C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



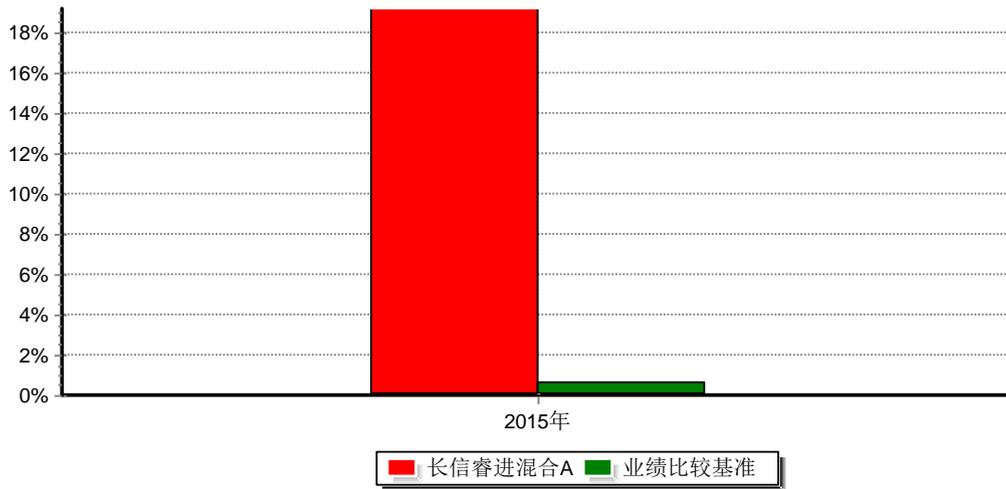
注：1、本基金基金合同生效日为2015年7月6日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年7月6日至2015年12月31日。

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，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：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。

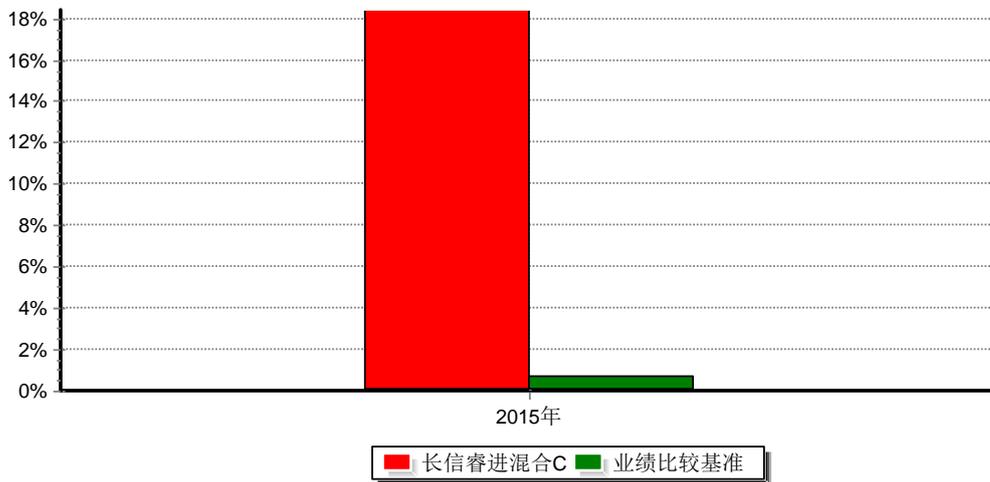
截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.1 长信睿进混合A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.2.3.2 长信睿进混合C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2015年7月6日，2015年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2015年7月6日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§ 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12月31日，本基金管理人共管理30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）、长信利鑫分级债、长信内需成长混合、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。

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		
谈洁颖	本基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵	2015年7月6日	—	11年	管理学学士，中国人民大学工商企业管理专业本科毕业生，具有基金从业资格。曾就职于北京大学，从事教育管理工作；2004年8月加入长信基金管理有限责任公司，历任研究助理、基金经理助理、专户理财投资经理，现任长信基金管理有限责任公司投资决策委员会执行委员、投资管理部总

	活配置混合型证券投资基金的基金经理、投资管理部总监、公司投资决策委员会执行委员				监、本基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5：1或以上的，可豁免启动

公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一年是A股市场有史以来杠杆上升最快的一年，融资额在很短的一段时间内迅速上升到全球第一。而其中大部分均来自于场外市场，对整体市场的研究深度并不充分。这样客观的事实造成了深度研究群体的丧失，叠加移动互联网信息传播速度呈几何级的快速发酵。从而造成2015年巨幅波动的一年。A股市场僧多粥少，存量资金扎堆寻找为数不多的优质资产，造成好资产被大幅透支未来盈利预期的局面。但同时，新经济继续主导市场，传媒、医疗、计算机、人工智能、军工和云平台及云服务等行业普遍成了传统企业转型的好去处。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信睿进混合A份额净值为1.192元，份额累计净值为1.192元，本报告期内长信睿进混合A净值增长率为19.20%；长信睿进混合C份额净值为1.184元，份额累计净值为1.184元，本报告期内长信睿进混合C净值增长率为18.40%。同期业绩比较基准收益率为0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年是存在宏观经济预期差的一年，而此也会影响到各个市场的联动效应和交叉感染，包括汇率、石油和大宗商品的价格波动，都会影响到A股市场。通过多次股灾之后的洗礼，市场对成长类资产的取舍眼光发生了些变化，不会是漫无边际的高估值就是高增长，业绩兑现开始得到体现，估值开始变得有意义。我们在追逐大量转型、创新机会的同时，都比较少的考虑到未来金融市场是个黑天鹅和黑洞频出的地方，也深刻需要理解市场的肥尾现象。我们在关注新产业新动向的同时，也应该看到传统行业复辟的机会，这些机会的投资逻辑不同于以往。比如保险公司为了减低股票波动的持有到期收益的风险，大幅增持低估值高分红蓝筹的传统行业龙头公司；比如2016年的估值切换，公司估值有底有顶都是有利于基本面研究出价值。再比如说到2016年最大的变数在于房地产，如果未来去库存、销售或者融资成本等优势让龙头越来越强，地产行业也可以讲收入和用户数的逻辑。那么，未来2016年的市场投资逻辑也会发生变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015年度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同

得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

在本报告期，基金管理人的内部监察稽核主要工作如下：

1、公司内部控制总体目标得以实现。一是公司各项业务运作严格遵守有关法律法规、监管机构的规定和行业监管规则，继续践行守法经营、规范管理的经营理念。二是公司未发生重大经营风险，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整。三是公司对外披露、备案、报送的基金信息、专户投资组合信息、公司财务信息及其他信息真实、准确、完整、及时。

2、公司继续贯彻“工作精细化”理念，落实“风险导向型”内控，有重点、有序推进相关内部控制工作。优化监察方式，在保证常规工作质量的前提下，继续深入贯彻监管机关的监管要求，组织多次全公司范围风险梳理工作，并根据公司内部控制要求落实包括年度全公司及子公司自查、销售适用性专项稽核、子公司内部控制专项稽核、专户管理专项稽核、信息安全自查、公司全面业务风险自查等多项自查工作。对于各项梳理及自查工作，公司各部门均以细致、全面的态度进行全面梳理，对于发现的问题及时沟通及通报，并督促整改，有效增强内部控制效果。

3、公司内部控制组织架构在公司章程与《内部控制大纲》规定的框架内顺利运作，董事会风险控制委员会、管理层内部控制委员会工作正常开展，相关内部控制职责得以充分发挥。

4、公司较好把握内控制度建设的整体节奏，并完成内部控制制度建设流程的梳理工作，内部控制制度体系不断完善。一是监察稽核部及时指出公司内部制度更新不及时、制度规定与实际操作不符等方面的问题，对内控制度建设的及时、有效、审慎性予以定期评估；二是对监管机关新修订的法律法规或新出台的监管要求，监察稽核部及时发起制定或修订公司相关内部制度；三是各业务部门不定期评估实际运作需要，适时发起制度的修订。

5、监察稽核工作改进、内部控制与合规培训、内控逐级责任制等内控保障性措施严格执行，内部控制与风险管理基础进一步夯实。各关键业务流程环节的岗位自控和互控、跨部门业务流程中的部门自控与部门间互控工作效果继续保持，各业务部门根据风险梳理工作要求，审视部门业务流程开展过程中的各项风

险，将各项内部控制要求落实到部门流程手册，相关业务流程持续协调更新，具体流程环节实现落实到岗，落实到人，内部控制细节不断深化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，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，本基金默认为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。

4.9 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，广发证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长信睿进灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配情况等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1600159 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信睿进灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“长信睿进混合基金”)财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年度7月6日至2015年12月31日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信睿进混合基金管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，长信睿进混合基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长信睿进混合基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度7月6日至2015年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	王国蓓、虞京京
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京东长安街1号东方广场东2座8层
审计报告日期	2016-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	7,386,507.62
结算备付金		1,209,956.20
存出保证金		603,475.91
交易性金融资产	7.4.7.2	123,049,020.85
其中：股票投资		123,049,020.85
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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	3,554.11
应收股利		—
应收申购款		472,575.64
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		132,725,090.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		1,314,096.90
应付管理人报酬		170,127.66

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

应付托管费		28,354.63
应付销售服务费		76,949.80
应付交易费用	7.4.7.7	429,914.00
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	200,157.10
负债合计		2,219,600.09
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	110,129,186.63
未分配利润	7.4.7.10	20,376,303.61
所有者权益合计		130,505,490.24
负债和所有者权益总计		132,725,090.33

注：1、报告截止日2015年12月31日，长信睿进混合A基金份额净值1.192元，份额总额17,226,366.28份，长信睿进混合C基金份额净值1.184元，份额总额92,902,820.35份。

2、本基金本报告期为2015年7月6日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年7月6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。

7.2 利润表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年7月6日(基金合同生效日)至2015 年12月31日
一、收入		37,488,246.52
1. 利息收入		288,109.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	288,109.84
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		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,441,228.49

其中：股票投资收益	7.4.7.12	33,361,617.73
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	79,610.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,416,646.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,342,261.49
减：二、费用		3,981,833.01
1. 管理人报酬		1,414,133.31
2. 托管费		235,688.96
3. 销售服务费		659,329.37
4. 交易费用	7.4.7.19	1,471,821.37
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.20	200,860.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,506,413.51
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,506,413.51

注：本基金本报告期为2015年7月6日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年7月6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。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31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	308,604,154.67	—	308,604,154.67

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	33,506,413.51	33,506,413.51
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)	-198,474,968.04	-13,130,109.90	-211,605,077.94
其中: 1. 基金申购款	232,789,821.00	26,906,015.61	259,695,836.61
2. 基金赎回款	-431,264,789.04	-40,036,125.51	-471,300,914.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	110,129,186.63	20,376,303.61	130,505,490.24

注: 本基金本报告期为2015年7月6日至2015年12月31日, 本基金基金合同于2015年7月6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7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信睿进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”)《关于准予长信睿进灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1164号)准予注册, 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《长信睿进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7月6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, 基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

本基金于2015年6月17日至2015年6月30日募集, 募集资金总额人民币308,524,024.87元, 利息转份额人民币80,129.80元, 募集规模为308,604,154.67

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1500365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、《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信睿进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、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)、资产支持证券、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。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 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12月31日的财务状况、自2015年7月6日至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历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7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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。

7.4.4.4 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，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

—所转移金融资产的账面价值

—因转移而收到的对价

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。

7.4.4.5 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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益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率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、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。

7.4.4.11 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12次，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。

7.4.4.12 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并披露分部信息。

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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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的初始投资成本，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的初始投资成本，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。

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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错。

7.4.6 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。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	7,386,507.62
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	7,386,507.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,632,374.15	123,049,020.85	2,416,646.70
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	120,632,374.15	123,049,020.85	2,416,646.70

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	2,737.71
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	544.50
应收债券利息	—

应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.30
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	271.60
合计	3,554.11

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	429,914.00
银行间市场应付交易费用	—
合计	429,914.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	157.10
预提信息披露费-上证报	50,000.00
预提信息披露费-中证报	50,000.00
预提信息披露费-证券时报	50,000.00
预提审计费	50,000.00
其它应付款	—
预提账户维护费	—
合计	200,157.10

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (长信睿进混合A)	本期 2015年7月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	34,971,320.32	34,971,320.32
本期申购	22,453,944.86	22,453,944.86
本期赎回(以“-”号填列)	-40,198,898.90	-40,198,898.90
本期末	17,226,366.28	17,226,366.28
项目	基金份额(份)	账面金额

(长信睿进混合C)		
基金合同生效日	273,632,834.35	273,632,834.35
本期申购	210,335,876.14	210,335,876.14
本期赎回(以“-”号填列)	-391,065,890.14	-391,065,890.14
本期末	92,902,820.35	92,902,820.35

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (长信睿进混合A)	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	4,326,518.38	-164,928.82	4,161,589.56
本期基金份额交易产生的变动数	-1,127,866.49	281,318.45	-846,548.04
其中：基金申购款	1,274,639.43	2,079,485.33	3,354,124.76
基金赎回款	-2,402,505.92	-1,798,166.88	-4,200,672.80
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,198,651.89	116,389.63	3,315,041.52
项目 (长信睿进混合C)	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	26,763,248.43	2,581,575.52	29,344,823.95
本期基金份额交易产生的变动数	-10,319,174.90	-1,964,386.96	-12,283,561.86
其中：基金申购款	6,233,302.30	17,318,588.55	23,551,890.85
基金赎回款	-16,552,477.20	-19,282,975.51	-35,835,452.71
本期已分配利润	—	—	—
本期末	16,444,073.53	617,188.56	17,061,262.09

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	278,784.68
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	6,844.49
其他	2,480.67
合计	288,109.84

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,361,617.73
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	33,361,617.73

7.4.7.12.2 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7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出股票成交总额	454,795,184.85
减：卖出股票成本总额	421,433,567.12
买卖股票差价收入	33,361,617.73

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	79,610.76
基金投资产生的股利收益	—
合计	79,610.76

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	2,416,646.70
——股票投资	2,416,646.70

——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	2,416,646.70

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,178,932.20
转换费收入	163,329.29
合计	1,342,261.49

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,471,821.37
银行间市场交易费用	—
合计	1,471,821.37

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	150,000.00
交易费用_回购	—
权证	—
账户维护费	—
银行手续费	460.00
其他费用	400.00
合计	200,860.00

注：其他费用为开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
广发证券股份有限公司	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
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	996,861,126.12	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量	期末应付佣金	占期末应付佣金

		的比例	余额	总额的比例
广发证券	925,665.28	100.00%	429,914.00	100.00%

注：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‰(或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‰(或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广发证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从广发证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,414,133.31
其中：支付销售机构的客户维护费	713,498.18

注：基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	235,688.96

注：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，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）。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期

各关联方名称	2015年7月6日（基金合同生效日）至2015年12月31日		
	长信睿进混合A	长信睿进混合C	合计
长信基金管理有限责任公司	—	5,567.60	5,567.60
广发股份有限公司	—	593,001.16	593,001.16
长江证券	—	180.36	180.36
合计	—	598,749.12	598,749.12

注：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0.80%。

销售服务费按照C类基金资产净值的0.80%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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金通过广发证券转存于中国建设银行股份有限公司的银行存款，于2015年12月31日的相关余额为人民币7,386,507.62元，相应产生的利息收入为278,784.68元。

本基金通过“广发证券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12月31日的相关余额为人民币1,209,956.20元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期没有进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.12.2 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 (股)	期末成本总额	期末估值总额
601377	兴业 证券	2015年12 月29日	配股	11.00	2016年 1月7日	9.40	516,900	6,325,457.09	5,685,900.00
000796	凯撒 旅游	2015年11 月9日	重大资 产重组	29.59	-	-	350,000	8,492,064.00	10,356,500.00
002544	杰赛 科技	2015年8 月31日	重大资 产重组	41.42	-	-	129,803	4,969,036.61	5,376,440.26

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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

额及设计相应内部控制流程，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、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。

7.4.13.2 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人广发证券股份有限公司在中国建设银行股份有限公司开立的托管账户，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。

(a) 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有短期信用债券投资。

(b) 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有长期信用债券投资。

7.4.13.3 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。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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人通过专设的金融工程部对本基金面临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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	7,386,507.62	—	—	—	—	7,386,507.62
结算备付金	1,209,956.20	—	—	—	—	1,209,956.20
存出保证金	603,475.91	—	—	—	—	603,475.91
交易性金融资产	—	—	—	—	123,049,020.85	123,049,020.85
应收利息	—	—	—	—	3,554.11	3,554.11
应收申购款	—	—	—	—	472,575.64	472,575.64

资产总计	9,199,939.73	—	—	—	123,525,150.60	132,725,090.33
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	1,314,096.90	1,314,096.90
应付管理人报酬	—	—	—	—	170,127.66	170,127.66
应付托管费	—	—	—	—	28,354.63	28,354.63
应付销售服务费	—	—	—	—	76,949.80	76,949.80
应付交易费用	—	—	—	—	429,914.00	429,914.00
其他负债	—	—	—	—	200,157.10	200,157.10
负债总计	—	—	—	—	2,219,600.09	2,219,600.09
利率敏感度缺口	9,199,939.73	—	—	—	121,305,550.51	130,505,490.24

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于2015年末未持有债券，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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 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，所面临的最大的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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2015年12月31日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的94.29%。于2015年12月31日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31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	123,049,020.85	94.29
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—
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	123,049,020.85	94.29

7.4.13.4.3.2 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12月31日)
	VaR值为5.10%	-6,655,780.00

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

(1) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。。

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31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	101,630,180.59	21,418,840.26	-	123,049,020.85
债券投资	-	-	-	-
合计	101,630,180.59	21,418,840.26	-	123,049,020.85

自2015年7月6日(基金合同生效日)至2015年12月31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。

(2) 第二层次的公允价值计量

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。

自2015年7月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间,本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.1 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	123,049,020.85	92.71
	其中：股票	123,049,020.85	92.71
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	8,596,463.82	6.48
7	其他各项资产	1,079,605.66	0.81
8	合计	132,725,090.33	100.00

注：本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	45,801,345.09	35.10
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	7,099,670.26	5.44
J	金融业	56,640,536.00	43.40

K	房地产业	2,496,207.50	1.91
L	租赁和商务服务业	10,356,500.00	7.94
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	654,762.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	123,049,020.85	94.29

8.2.2 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。

8.3 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	600562	国睿科技	210,213	13,073,146.47	10.02
2	002023	海特高新	657,713	12,062,456.42	9.24
3	000796	凯撒旅游	350,000	10,356,500.00	7.94
4	002625	龙生股份	199,600	9,710,540.00	7.44
5	601198	东兴证券	323,500	9,695,295.00	7.43
6	002736	国信证券	384,800	7,599,800.00	5.82
7	601555	东吴证券	455,400	7,318,278.00	5.61
8	002500	山西证券	433,500	6,606,540.00	5.06
9	000750	国海证券	478,100	6,143,585.00	4.71
10	601377	兴业证券	516,900	5,685,900.00	4.36
11	002544	杰赛科技	129,803	5,376,440.26	4.12
12	601099	太平洋	370,000	3,633,400.00	2.78
13	600369	西南证券	360,000	3,564,000.00	2.73
14	601788	光大证券	140,700	3,227,658.00	2.47
15	601901	方正证券	329,800	3,166,080.00	2.43
16	002026	山东威达	170,000	2,995,400.00	2.30
17	002448	中原内配	200,000	2,852,000.00	2.19
18	300065	海兰信	67,301	2,570,898.20	1.97
19	000718	苏宁环球	189,250	2,496,207.50	1.91
20	300245	天玑科技	41,000	1,723,230.00	1.32

21	002137	麦达数字	55,900	1,285,700.00	0.99
22	600146	商赢环球	38,100	1,251,204.00	0.96
23	300347	泰格医药	21,300	654,762.00	0.50

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000690	宝新能源	39,054,711.34	29.93
2	600343	航天动力	17,584,582.06	13.47
3	002023	海特高新	17,395,522.73	13.33
4	002171	楚江新材	16,207,378.27	12.42
5	300397	天和防务	15,956,404.90	12.23
6	601198	东兴证券	14,392,028.00	11.03
7	601021	春秋航空	14,324,757.33	10.98
8	002625	龙生股份	13,848,710.00	10.61
9	600050	中国联通	13,823,029.00	10.59
10	002462	嘉事堂	13,350,025.81	10.23
11	600562	国睿科技	12,786,255.29	9.80
12	300159	新研股份	12,711,590.90	9.74
13	300252	金信诺	12,710,587.41	9.74
14	300324	旋极信息	12,139,985.42	9.30
15	300489	中飞股份	11,163,575.20	8.55
16	600666	奥瑞德	10,945,501.00	8.39
17	600016	XD民生银	10,622,675.00	8.14
18	600491	龙元建设	10,265,162.11	7.87
19	600017	日照港	9,496,918.00	7.28
20	600958	东方证券	9,306,256.80	7.13
21	601186	中国铁建	9,073,153.70	6.95
22	002736	国信证券	9,056,738.00	6.94
23	601555	东吴证券	8,908,505.00	6.83
24	000796	凯撒旅游	8,492,064.00	6.51
25	002570	贝因美	8,066,660.07	6.18
26	000960	锡业股份	7,833,589.82	6.00
27	002500	山西证券	7,696,444.00	5.90
28	000768	中航飞机	7,536,396.08	5.77

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

29	000750	国海证券	7,420,466.23	5.69
30	600276	恒瑞医药	7,090,499.00	5.43
31	601377	兴业证券	7,071,932.00	5.42
32	000008	神州高铁	6,829,142.50	5.23
33	300463	迈克生物	6,117,417.00	4.69
34	300065	海兰信	5,829,740.34	4.47
35	002217	合力泰	5,261,484.70	4.03
36	600198	大唐电信	5,056,555.00	3.87
37	600196	复星医药	4,995,100.97	3.83
38	002544	杰赛科技	4,969,036.61	3.81
39	300431	暴风科技	4,842,974.00	3.71
40	000963	华东医药	4,783,625.70	3.67
41	002008	大族激光	4,765,838.20	3.65
42	601099	太平洋	4,749,575.00	3.64
43	000672	上峰水泥	4,696,487.27	3.60
44	601788	光大证券	4,590,694.00	3.52
45	600369	西南证券	4,575,361.00	3.51
46	002673	西部证券	4,564,554.00	3.50
47	000693	华泽钴镍	4,524,023.00	3.47
48	002517	恺英网络	4,447,860.00	3.41
49	601901	方正证券	4,316,000.00	3.31
50	600618	氯碱化工	4,296,811.35	3.29
51	600519	贵州茅台	4,110,000.00	3.15
52	300332	天壕环境	4,087,963.00	3.13
53	600060	海信电器	3,784,000.00	2.90
54	002348	高乐股份	3,701,500.00	2.84
55	601169	北京银行	3,564,415.00	2.73
56	000036	华联控股	3,351,058.00	2.57
57	600278	东方创业	3,313,209.95	2.54
58	002615	哈尔斯	3,312,366.00	2.54
59	002520	日发精机	3,219,175.00	2.47
60	300109	新开源	3,058,417.62	2.34
61	000039	中集集团	2,933,562.38	2.25
62	000797	中国武夷	2,910,000.00	2.23
63	600298	安琪酵母	2,872,015.30	2.20
64	002448	中原内配	2,800,100.00	2.15
65	002026	山东威达	2,779,665.00	2.13

66	600340	华夏幸福	2,689,929.04	2.06
67	000718	苏宁环球	2,687,757.50	2.06
68	000418	小天鹅A	2,615,680.08	2.00

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。

8.4.2 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	000690	宝新能源	31,746,282.53	24.33
2	600343	航天动力	21,766,427.66	16.68
3	300252	金信诺	18,309,588.78	14.03
4	300324	旋极信息	18,134,977.72	13.90
5	002171	楚江新材	18,129,199.93	13.89
6	601021	春秋航空	15,232,087.88	11.67
7	300397	天和防务	15,113,374.00	11.58
8	300159	新研股份	14,658,223.62	11.23
9	600050	中国联通	14,132,483.90	10.83
10	300489	中飞股份	13,729,085.64	10.52
11	600666	奥瑞德	12,990,004.50	9.95
12	002462	嘉事堂	12,853,797.88	9.85
13	600491	龙元建设	11,751,300.84	9.00
14	600016	XD民生银	10,978,908.63	8.41
15	000768	中航飞机	8,927,648.29	6.84
16	002570	贝因美	8,766,974.48	6.72
17	600958	东方证券	8,688,374.01	6.66
18	601186	中国铁建	7,693,011.30	5.89
19	000008	神州高铁	7,467,324.93	5.72
20	600276	恒瑞医药	7,249,759.10	5.56
21	002023	海特高新	6,932,590.62	5.31
22	600017	日照港	6,918,283.00	5.30
23	300463	迈克生物	6,914,136.00	5.30
24	000960	锡业股份	6,806,517.46	5.22
25	600562	国睿科技	6,570,670.04	5.03
26	002217	合力泰	6,245,511.64	4.79
27	300431	暴风科技	5,795,896.40	4.44
28	601198	东兴证券	5,544,038.00	4.25
29	002008	大族激光	5,315,377.58	4.07
30	600196	复星医药	5,282,379.25	4.05

31	002673	西部证券	5,238,672.00	4.01
32	600198	大唐电信	5,122,650.00	3.93
33	002517	恺英网络	5,093,366.89	3.90
34	002615	哈尔斯	5,043,900.00	3.86
35	300332	天壕环境	4,946,677.50	3.79
36	000672	上峰水泥	4,911,129.00	3.76
37	000963	华东医药	4,645,047.90	3.56
38	600618	氯碱化工	4,611,515.34	3.53
39	300065	海兰信	4,586,134.45	3.51
40	002348	高乐股份	4,518,940.50	3.46
41	600060	海信电器	4,333,435.00	3.32
42	000693	华泽钴镍	4,271,000.45	3.27
43	601169	北京银行	4,150,099.00	3.18
44	300109	新开源	3,986,029.50	3.05
45	600278	东方创业	3,845,550.00	2.95
46	600519	贵州茅台	3,780,287.00	2.90
47	002520	日发精机	3,474,272.22	2.66
48	300479	神思电子	3,434,011.24	2.63
49	002625	龙生股份	3,257,838.00	2.50
50	000039	中集集团	3,184,593.59	2.44
51	000036	华联控股	2,977,899.00	2.28
52	600340	华夏幸福	2,950,283.00	2.26
53	300136	信维通信	2,943,574.00	2.26
54	000797	中国武夷	2,827,550.00	2.17

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。

8.4.3 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	542,065,941.27
卖出股票收入（成交）总额	454,795,184.85

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，国信证券（002736）的发行主体于2015年11月26日收到中国证监会下发的《调查通知书》（稽查总队调查通字[153145]号）。因该公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对该公司立案调查。

对如上股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名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

8.12.2 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。

8.12.3 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	603,475.91
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,554.11
5	应收申购款	472,575.64
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,079,605.66

8.12.4 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。

8.12.5 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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000796	凯撒旅游	10,356,500.00	7.94	停牌
2	601377	兴业证券	5,685,900.00	4.36	停牌

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
长信睿进混合A	1,636	10,529.56	0.00	0.00%	17,226,366.28	100.00%
长信睿进混合C	3,211	28,932.68	12,572.81	0.01%	92,890,247.54	99.99%
合计	4,847	22,721.10	12,572.81	0.01%	110,116,613.82	99.99%

9.2 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	长信睿进混合A	0	0.00%
	长信睿进混合C	2.06	0.00%
	合计	2.06	0.00%

9.3 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	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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	长信睿进混合A	0
	长信睿进混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信睿进混合A	0
	长信睿进混合C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	长信睿进混合A	长信睿进混合C
基金合同生效日(2015年7月6日)基金份额总额	34,971,320.32	273,632,834.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	22,453,944.86	210,335,876.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	40,198,898.90	391,065,890.14
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	17,226,366.28	92,902,820.35

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1 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《基金行业高级管理人员变更公告》。

11.2.2 报告期内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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币50,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为1年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	996,861,126.12	100.00%	925,665.28	100.00%	

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内新增广发证券2个席位。

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。

11.8 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	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金	上证报、中证报、	2015-6-13

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

	份额发售公告	证券时报	
2	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金基金合同	上证报、中证报、 证券时报	2015-6-13
3	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	上证报、中证报、 证券时报	2015-6-13
4	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2015-6-13
5	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合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	2015-7-7
6	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合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	2015-7-13
7	长信基金管理有限责任公司关于长信睿进灵活配置混合型证券投资基金在广发证券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	2015-7-16
8	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上海浦东发展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	2015-7-30
9	长信基金管理有限责任公司关于增加浙江同花顺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	2015-8-12
10	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平安银行股份有限公司申购（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	2015-8-12
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海天天基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报	2015-8-22
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海汇付金融服务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	2015-9-10
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加上海好买基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报	2015-9-24
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开	上证报、中证报、	2015-10-16

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

	放式证券投资基金参加平安证券有限责任公司申购费率优惠的公告	证券时报、证券日报	
15	长信基金管理有限责任公司关于“长金通”网上直销平台申购（含定期定额申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-10-21
16	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	上证报、中证报、证券时报	2015-10-26
17	长信基金管理有限责任公司关于增加大泰金石投资管理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	2015-10-29
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-11-16
19	长信基金管理有限责任公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-11-26
20	长信基金管理有限责任公司关于增加上海联泰资产管理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	2015-12-1
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安证券有限责任公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-18
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金组合申购、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	2015-12-30
23	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-12-30
24	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2015-12-30
25	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整开放时间的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十六日